

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

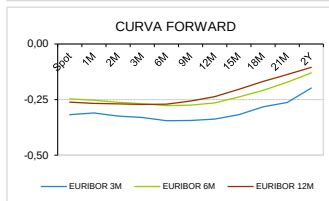
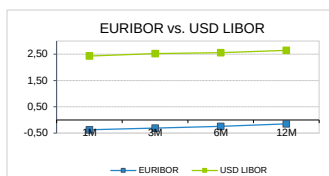
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

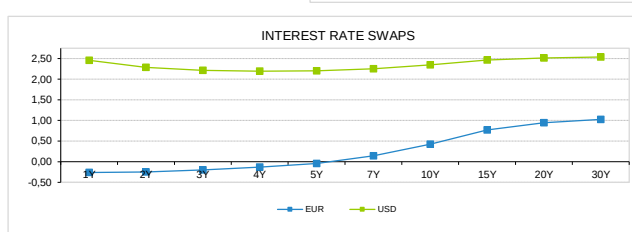
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3720	0	0	1M	2,4298	-1	-5	0,7301	-0,7910
3M	-0,3110	0	0	3M	2,5206	0	-6	0,7958	-0,7108
6M	-0,2410	0	-1	6M	2,5601	-1	-6	0,8936	-0,6556
12M	-0,1480	0	-4	12M	2,6448	-2	-9	1,0239	-0,5192

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2617	0	-3	-0,2375	0,0806	0,4876
2Y	-0,2500	0	-5	-0,1705	0,1852	0,5850
3Y	-0,2010	-1	-7	-0,0870	0,2849	0,6870
4Y	-0,1300	-1	-9	0,0064	0,3840	0,7830
5Y	-0,0450	-1	-10	0,0998	0,4850	0,8700
7Y	0,1420	-1	-12	0,2946	0,6720	1,0190
10Y	0,4240	-1	-13	0,5647	0,8903	1,1710
15Y	0,7700	-1	-13	0,8622	1,0867	1,2760
20Y	0,9430	-1	-13	1,0043	1,1597	1,2800
30Y	1,0260	-1	-13	1,0539	1,1465	1,2150

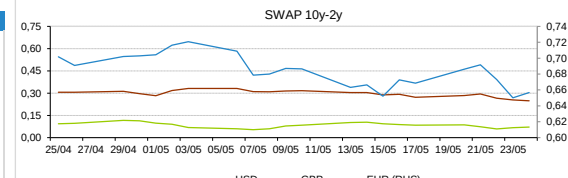
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,4580	-1	-14	2,0086	2,0441	2,2510
2Y	2,2850	-3	-19	1,9560	2,0880	2,3107
3Y	2,2130	-4	-21	2,0000	2,1582	2,3570
4Y	2,1940	-4	-21	2,0388	2,2059	2,3997
5Y	2,2020	-4	-22	2,0660	2,2517	2,4380
7Y	2,2530	-4	-22	2,1670	2,3382	2,4995
10Y	2,3470	-5	-22	2,2874	2,4284	2,5507
15Y	2,4640	-4	-22	2,3988	2,4991	2,5795
20Y	2,5160	-4	-22	2,4484	2,5209	2,5750
30Y	2,5380	-4	-22	2,4675	2,5127	2,5462

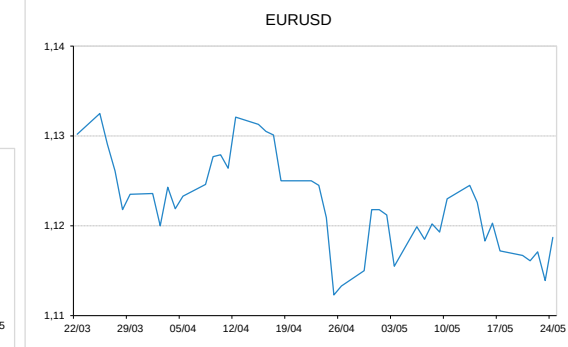
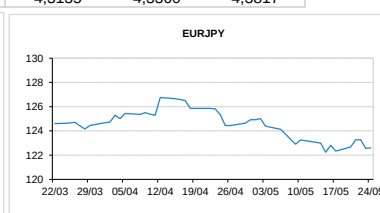


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	67,82	0,06	-6,02	OT 2Y	-0,385	0,00	-4,60
JETFUEL	639,91	-2,09	-40,21	OT 5Y	0,023	-0,01	-11,20
DIESEL	610,16	-2,84	-39,84	OT 10Y	0,974	-0,04	-19,70
COBRE	5.942,00	-2,00	-481,00	BUND 10Y	-0,531	-0,28	-11,00
ZINCO	2.615,00	-7,00	-155,00	SCHATZ 2Y	-0,016	-0,23	-4,80
OURO	1.283,89	-1,90	8,04	T-NOTE 10Y	3,081	2,55	-14,70
TRIGO	483,75	13,50	45,25	T-NOTE 2Y	2,565	2,71	-12,00
LICENÇA C02	25,44	-0,62	-1,96	GILT 10Y	0,869	-1,17	-22,50



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1187	0,43%	-0,20%	1,1274	1,1358	1,1519
EUR/GBP	0,88318	-0,25%	-2,01%	0,8859	0,8887	0,8948
EUR/JPY	122,61	-0,04%	2,23%	122,61	122,61	122,61
EUR/CHF	1,1223	-0,01%	1,49%	1,1212	1,1201	1,1179
EUR/BRL	4,5091	0,15%	-1,24%	4,5805	4,6499	4,7778
EUR/PLN	4,2915	0,32%	0,11%	4,3135	4,3360	4,3817



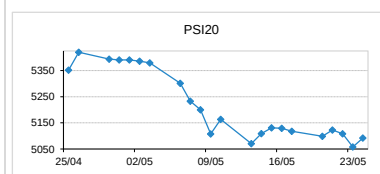
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1187	0,8832	122,61	1,1223	10,7011	7,4686	1,5069	1,61981	4,5091	9,7506
USD	0,8925	-	0,7879	109,355	1,0019	9,5521	6,6658	1,3461	1,4459	4,0416	8,7088

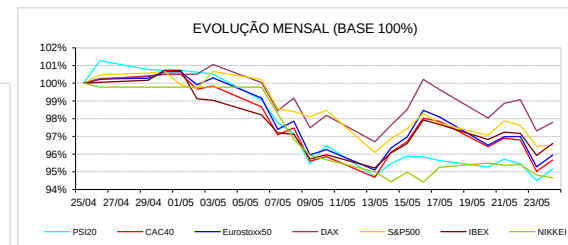
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,160	0,49	6,21
BCP	0,253	1,08	10,37
CORT. AMORIM	10,300	-2,65	14,44
CTT	2,260	-1,65	-23,29
EDP	3,320	1,75	8,89
EDP R	8,760	-0,11	12,67
GALP	14,010	0,32	1,56
IBERSOL	8,080	0,00	2,28
J MARTINS	13,605	1,42	31,58
MOTA ENGIL	2,106	0,86	30,81
NAVIGATOR	3,352	0,06	-6,89
NOS	5,555	-0,09	4,91
NOVABASE	2,350	-0,42	16,34
PHAROL	0,149	1,36	-8,46
RAMADA	7,660	0,26	2,13
REN	12,780	-0,16	-2,44
SEMAPA	0,811	-0,49	-4,48
SONAE CAP.	0,901	1,64	11,17
SONAE SGPS	7,660	0,26	2,13

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP	1,75
SONAE CAP.	1,64
J MARTINS	1,42
PHAROL	1,36
BCP	1,08
REN	-0,16
NOVABASE	-0,42
SEMAPA	-0,49
CTT	-1,65
CORT. AMORIM	-2,65



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.092,38	0,68%	7,63%	5.712,29	4.551,84
CAC40	5.316,79	0,67%	12,39%	5.601,38	4.555,99
ESTX 50 PR	3.350,34	0,70%	11,63%	3.560,56	2.908,70
XTRA DAX	12.011,42	0,49%	13,76%	13.170,05	10.279,20
S&P 500	2.823,93	0,06%	12,65%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.178,00	0,70%	7,47%	10.092,20	8.286,20
NIKKEI 225	21.117,22	-0,16%	5,51%	24.448,07	18.948,58



A informação mencionada é meramente indicativa e reflecte o mercado pelas 16h30. As opiniões emitidas não podem ser entendidas como conselho ou recomendação para a prática de qualquer acto. A informação foi recolhida de fontes consideradas fiáveis, não se responsabilizando, no entanto, o CaixaBI por quaisquer incorrecções que as mesmas possam conter. Para mais informações, contactar a Sala de Mercados (Assessoria e Gestão de Risco a Empresas) do CaixaBI.

2017 © Caixa - Banco de Investimento, SA. Todos os direitos reservados.

O Caixa - Banco de Investimento, S.A. é membro da Euronext e é um intermediário financeiro registado na CMVM com o número 102.