

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

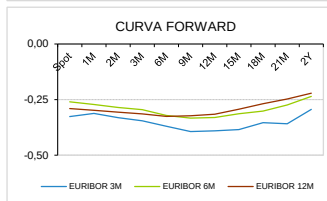
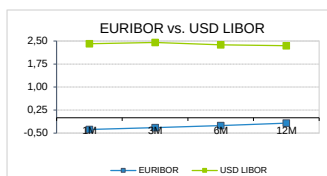
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

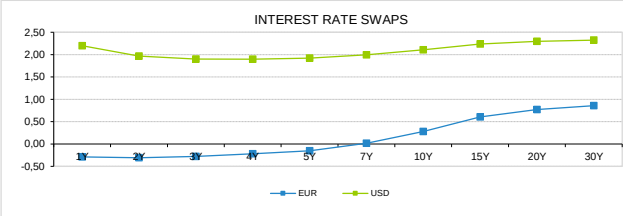
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3810	0	-1	1M	2,4116	-1	-6	0,7244	-0,8018
3M	-0,3190	0	-1	3M	2,4530	-2	-11	0,7856	-0,7114
6M	-0,2560	0	-3	6M	2,3779	-3	-24	0,8654	-0,6664
12M	-0,1750	1	-6	12M	2,3476	-3	-40	0,9743	-0,5376

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2900	-1	-6	-0,3164	-0,0690	0,2935
2Y	-0,3080	-3	-11	-0,2684	0,0224	0,3870
3Y	-0,2780	-3	-14	-0,2025	0,1110	0,4911
4Y	-0,2180	-3	-16	-0,1235	0,2050	0,5849
5Y	-0,1510	-4	-18	-0,0410	0,3046	0,6640
7Y	0,0160	-3	-20	0,1376	0,4780	0,7935
10Y	0,2780	-2	-23	0,3866	0,6756	0,9359
15Y	0,6040	-2	-25	0,6563	0,8575	1,0352
20Y	0,7720	-1	-25	0,7889	0,9276	1,0365
30Y	0,8570	-1	-24	0,8369	0,9173	0,9774

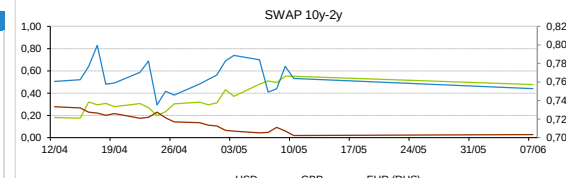
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,25
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,1970	-1	-36	1,6711	1,8150	2,0985
2Y	1,9670	1	-47	1,6887	1,8780	2,1466
3Y	1,8990	1	-47	1,7180	1,9440	2,1695
4Y	1,8970	1	-46	1,7898	2,0020	2,2389
5Y	1,9210	1	-45	1,8320	2,0480	2,2822
7Y	1,9950	2	-42	1,9410	2,1395	2,3135
10Y	2,1080	2	-40	2,0760	2,2355	2,3655
15Y	2,2370	2	-38	2,1925	2,3120	2,3970
20Y	2,2950	2	-38	2,2530	2,3696	2,3920
30Y	2,3230	2	-37	2,2735	2,3235	2,3550

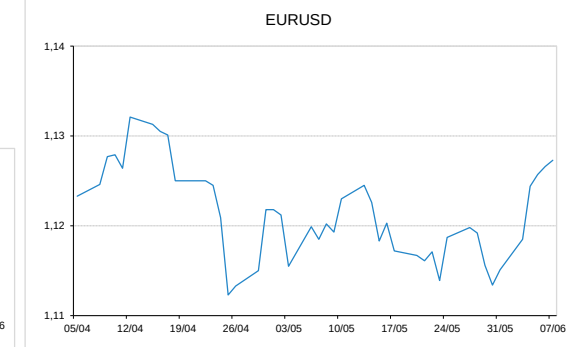
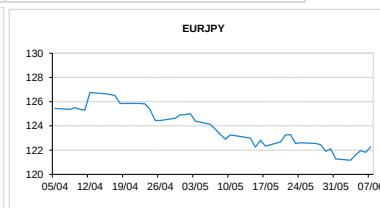
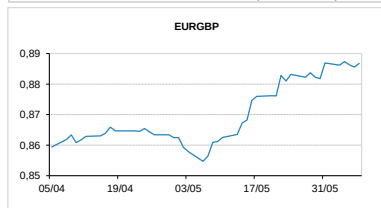


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,73	1,06	-6,34	OT 2Y	-0,374	0,00	-4,30
JETFUEL	580,47	-16,58	-96,06	OT 5Y	-0,111	-0,03	-17,60
DIESEL	547,59	0,37	-88,17	OT 10Y	0,620	-0,05	-46,60
COBRE	5.839,00	1,00	-428,00	BUND 10Y	-0,845	-2,22	-23,20
ZINCO	2.609,50	54,50	-199,50	SCHATZ 2Y	-0,055	-1,83	-7,30
OURO	1.343,84	4,59	59,57	T-NOTE 10Y	2,834	-4,69	-34,70
TRIGO	509,25	-0,75	69,75	T-NOTE 2Y	2,124	-5,94	-45,60
LICENÇA C02	24,45	0,47	-1,95	GILT 10Y	0,806	-2,24	-33,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1273	0,06%	0,79%	1,1357	1,1432	1,1575
EUR/GBP	0,88675	-0,13%	-3,42%	0,8895	0,8924	0,8984
EUR/JPY	122,27	-0,37%	1,19%	122,27	122,27	122,27
EUR/CHF	1,1189	-0,18%	1,99%	1,1178	1,1168	1,1145
EUR/BRL	4,3759	0,03%	1,53%	4,4436	4,5064	4,6278
EUR/PLN	4,2616	0,31%	0,70%	4,2827	4,3048	4,3524



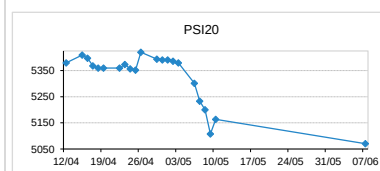
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1273	0,8868	122,27	1,1189	10,6455	7,4683	1,5055	1,61779	4,3759	9,7758
USD	0,8820	-	0,7839	108,015	0,9872	9,3879	6,5865	1,3289	1,4258	3,8538	8,6180

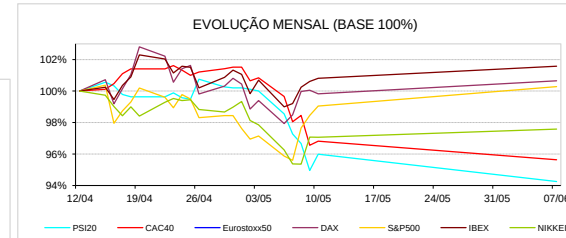
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,935	0,42	2,33
BCP	0,253	1,40	10,20
CORT. AMORIM	9,960	0,40	10,67
CTT	2,274	-0,18	-22,81
EDP	3,461	1,35	13,51
EDP R	9,120	0,77	17,30
GALP	13,610	2,02	-1,38
IBERSOL	8,040	-0,74	1,77
J MARTINS	14,525	1,36	40,47
MOTA ENGIL	1,899	0,00	17,95
NAVIGATOR	3,194	-0,37	-11,28
NOS	5,725	0,70	8,12
NOVABASE	2,200	0,46	8,91
PHAROL	0,146	0,69	-10,54
RAMADA	7,380	-1,34	-1,60
REN	12,220	0,66	-6,72
SEMAPA	0,771	0,13	-9,19
SONAE CAP.	0,901	0,67	11,17
SONAE SGPS	7,380	-1,34	-1,60

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
GALP	2,02
BCP	1,40
J MARTINS	1,36
EDP	1,35
EDP R	0,77
CTT	-0,18
NAVIGATOR	-0,37
IBERSOL	-0,74
RAMADA	-1,34
RAMADA	-1,34



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.134,40	0,84%	8,52%	5.701,90	4.551,84
CAC40	5.369,59	1,73%	13,51%	5.601,38	4.555,99
ESTX 50 PR	3.380,56	1,26%	12,63%	3.540,64	2.908,70
XTRA DAX	12.052,71	0,83%	14,14%	13.170,05	10.279,20
S&P 500	2.879,15	1,25%	14,84%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.240,00	0,76%	8,18%	9.985,90	8.286,20
NIKKEI 225	20.884,71	0,53%	4,35%	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.