

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

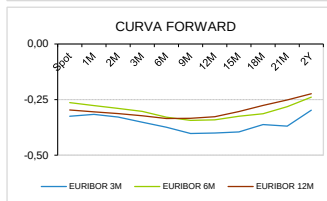
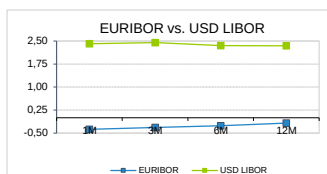
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

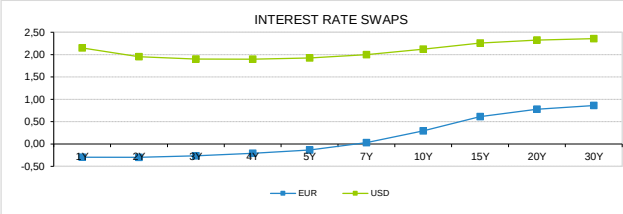
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3770	0	-1	1M	2,4106	0	-4	0,7248	-0,8004
3M	-0,3180	0	-1	3M	2,4495	1	-8	0,7880	-0,7084
6M	-0,2590	0	-3	6M	2,3520	0	-24	0,8700	-0,6636
12M	-0,1730	1	-6	12M	2,3433	1	-35	0,9865	-0,5380

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2960	-1	-6	-0,3286	-0,0605	0,3207
2Y	-0,2980	0	-9	-0,2753	0,0352	0,4205
3Y	-0,2660	0	-12	-0,2028	0,1305	0,5239
4Y	-0,2080	1	-13	-0,1191	0,2274	0,6215
5Y	-0,1360	1	-15	-0,0315	0,3265	0,7005
7Y	0,0290	1	-17	0,1550	0,5103	0,8443
10Y	0,2920	2	-19	0,4157	0,7171	0,9877
15Y	0,6120	2	-22	0,6967	0,9076	1,0916
20Y	0,7780	2	-22	0,8361	0,9827	1,1000
30Y	0,8600	2	-22	0,8908	0,9763	1,0399

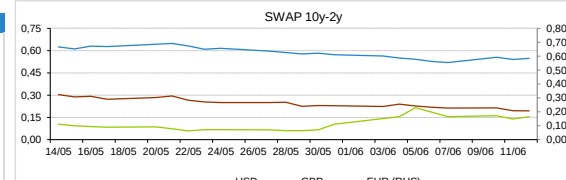
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,25
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,1480	5	-33	1,7303	1,8346	2,0840
2Y	1,9530	7	-38	1,6905	1,8790	2,1639
3Y	1,8990	8	-37	1,7315	1,9460	2,1990
4Y	1,8970	8	-36	1,7815	2,0110	2,2430
5Y	1,9230	8	-34	1,8607	2,0665	2,3039
7Y	1,9990	7	-31	1,9545	2,1808	2,3681
10Y	2,1200	7	-29	2,0915	2,2630	2,4215
15Y	2,2590	7	-26	2,2170	2,3626	2,4566
20Y	2,3230	7	-25	2,2715	2,3620	2,4250
30Y	2,3570	7	-24	2,3110	2,3740	2,4206

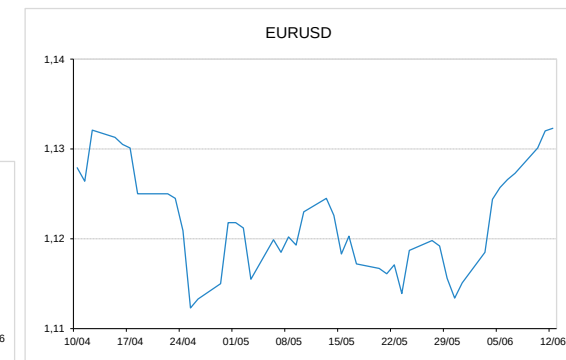
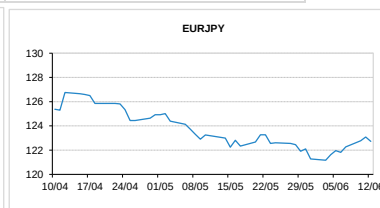
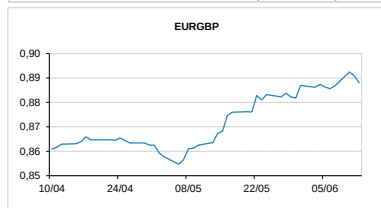


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	60,79	-1,50	-8,85	OT 2Y	-0,308	0,01	2,20
JETFUEL	590,09	-6,30	-81,91	OT 5Y	-0,050	0,02	-16,90
DIESEL	556,34	-6,80	-84,66	OT 10Y	0,656	0,01	-50,00
COBRE	5.891,00	2,00	-250,00	BUND 10Y	-0,822	-0,35	-18,50
ZINCO	2.621,50	39,50	-48,00	SCHATZ 2Y	-0,057	-0,69	-5,90
OURO	1.335,56	7,10	47,49	T-NOTE 10Y	2,874	-2,04	-23,50
TRIGO	523,25	5,25	98,50	T-NOTE 2Y	2,193	-3,64	-27,50
LICENÇA C02	24,87	-0,11	-0,75	GILT 10Y	0,868	2,52	-23,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1323	0,03%	0,69%	1,1408	1,1483	1,1629
EUR/GBP	0,88805	0,32%	-2,76%	0,8909	0,8939	0,9003
EUR/JPY	122,72	0,30%	0,28%	122,72	122,72	122,72
EUR/CHF	1,1246	-0,09%	0,49%	1,1235	1,1224	1,1202
EUR/BRL	4,3421	0,65%	3,24%	4,4088	4,4707	4,5911
EUR/PLN	4,2577	0,12%	1,18%	4,2789	4,3010	4,3490



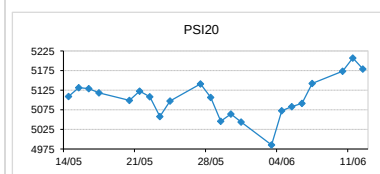
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1323	0,8881	122,72	1,1246	10,6905	7,4676	1,5043	1,62912	4,3421	9,7769
USD	0,8835	-	0,786	108,465	0,9940	9,4398	6,5974	1,3278	1,4394	3,8372	8,6316

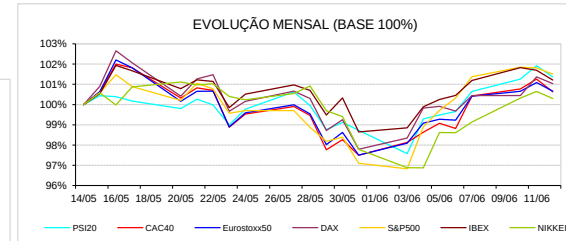
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,140	0,66	5,86
BCP	0,261	-0,69	13,51
CORT. AMORIM	10,060	-0,98	11,78
CTT	2,242	-2,61	-23,90
EDP	3,449	0,03	13,12
EDP R	9,070	-0,33	16,66
GALP	13,310	-3,52	-3,52
IBERSOL	8,000	0,00	1,27
J MARTINS	14,655	0,51	41,73
MOTA ENGL	1,933	-1,07	20,06
NAVIGATOR	3,274	-0,73	-9,06
NOS	5,810	0,00	9,73
NOVABASE	2,280	0,44	12,87
PHAROL	0,155	0,26	-5,27
RAMADA	7,360	-0,27	-1,87
REN	12,340	-1,44	-5,80
SEMAPA	0,771	-1,15	-9,19
SONAE CAP.	0,905	-0,39	11,73
SONAE SGPS	7,360	-0,27	-1,87

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	0,66
J MARTINS	0,51
NOVABASE	0,44
PHAROL	0,26
EDP	0,03
MOTA ENGL	-1,07
SEMAPA	-1,15
REN	-1,44
CTT	-2,61
GALP	-3,52



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.179,13	-0,54%	9,46%	5.701,90	4.551,84
CAC40	5.374,92	-0,62%	13,62%	5.601,38	4.555,99
ESTX 50 PR	3.386,63	-0,43%	12,83%	3.540,64	2.908,70
XTRA DAX	12.115,68	-0,33%	14,74%	13.170,05	10.279,20
S&P 500	2.877,49	-0,29%	14,77%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.238,50	-0,47%	8,18%	9.985,90	8.286,20
NIKKEI 225	21.129,72	-0,35%	5,57%	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.