

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

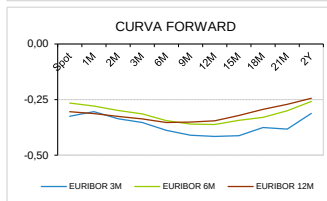
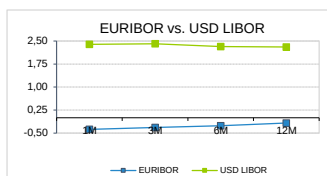
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

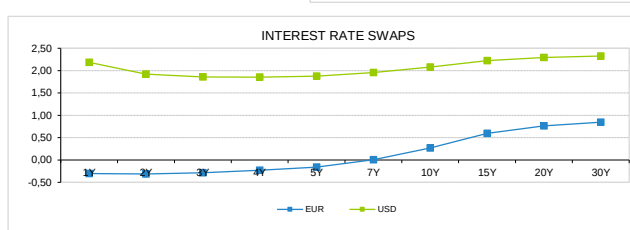
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3780	0	-1	1M	2,3943	-1	-5	0,7248	-0,8014
3M	-0,3180	0	-1	3M	2,4103	-2	-11	0,7890	-0,7116
6M	-0,2610	0	-3	6M	2,3184	-2	-27	0,8696	-0,6640
12M	-0,1710	0	-5	12M	2,3056	-3	-37	0,9859	-0,5362

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3045	-1	-6	-0,3465	-0,0713	0,2886
2Y	-0,3130	-1	-10	-0,2946	0,0251	0,3894
3Y	-0,2850	-1	-13	-0,2205	0,1148	0,4900
4Y	-0,2290	-1	-15	-0,1354	0,2078	0,5837
5Y	-0,1580	-1	-16	-0,0503	0,3039	0,6630
7Y	0,0050	-1	-18	0,1310	0,4808	0,7996
10Y	0,2680	-1	-20	0,3820	0,6773	0,9369
15Y	0,5940	0	-22	0,6530	0,8570	1,0300
20Y	0,7620	0	-22	0,7840	0,9228	1,0344
30Y	0,8450	0	-22	0,8226	0,9035	0,9651

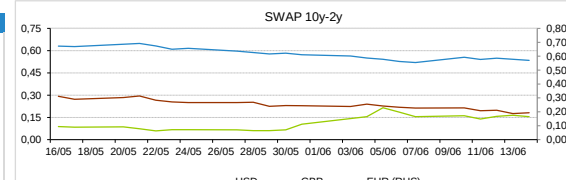
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,25
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,1830	4	-30	1,6813	1,7715	2,0524
2Y	1,9200	-7	-41	1,6385	1,8545	2,0860
3Y	1,8570	-7	-41	1,6815	1,9171	2,1335
4Y	1,8530	-7	-40	1,7365	1,9759	2,1999
5Y	1,8750	-7	-38	1,7925	2,0130	2,2439
7Y	1,9550	-6	-36	1,8990	2,1020	2,2845
10Y	2,0800	-5	-33	2,0580	2,2090	2,3380
15Y	2,2240	-4	-30	2,1680	2,2880	2,3999
20Y	2,2920	-3	-28	2,2270	2,3100	2,3710
30Y	2,3260	-2	-27	2,2490	2,2980	2,3260

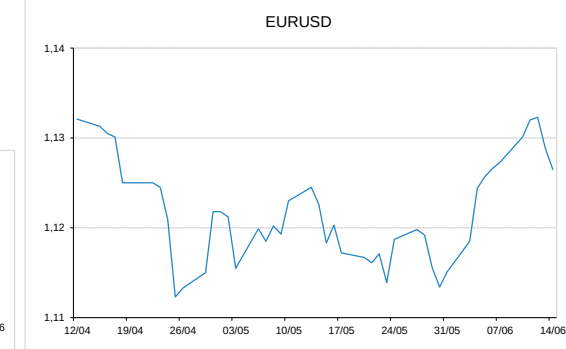
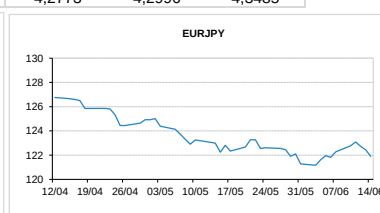


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	61,97	0,66	-8,34	OT 2Y	-0,327	-0,01	1,00
JETFUEL	594,00	3,91	-80,50	OT 5Y	-0,061	0,00	-15,70
DIESEL	559,25	2,91	-84,50	OT 10Y	0,607	-0,04	-51,90
COBRE	5.863,50	6,00	-153,00	BUND 10Y	-0,844	-1,31	-17,60
ZINCO	2.582,00	-35,50	-35,00	SCHATZ 2Y	-0,073	-1,60	-5,00
OURO	1.350,37	10,85	54,45	T-NOTE 10Y	2,840	0,16	-24,10
TRIGO	543,00	4,00	87,00	T-NOTE 2Y	2,164	2,30	-28,10
LICENÇA C02	25,08	0,12	-0,81	GILT 10Y	0,845	1,35	-23,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1265	-0,21%	0,35%	1,1347	1,1421	1,1564
EUR/GBP	0,89093	-0,16%	-2,66%	0,8938	0,8967	0,9032
EUR/JPY	121,9	0,44%	0,90%	121,90	121,90	121,90
EUR/CHF	1,1208	0,08%	0,94%	1,1197	1,1186	1,1165
EUR/BRL	4,3681	-0,64%	1,96%	4,4341	4,4931	4,6137
EUR/PLN	4,2563	-0,03%	1,19%	4,2773	4,2996	4,3485



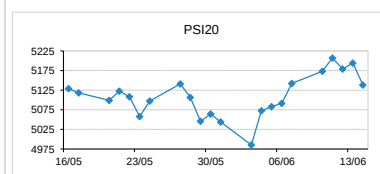
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1265	0,8909	121,90	1,1208	10,6406	7,4674	1,5017	1,63211	4,3681	9,7776
USD	0,8910	-	0,7932	108,435	0,9983	9,4759	6,6532	1,3370	1,4540	3,8844	8,7111

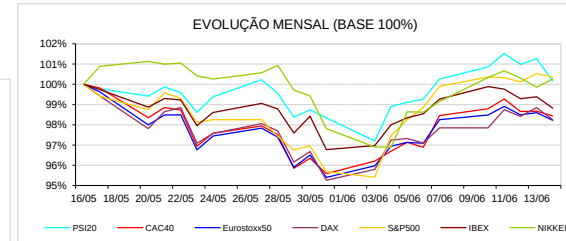
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,280	-2,79	8,28
BCP	0,257	-2,58	12,03
CORT. AMORIM	10,100	-0,79	12,22
CTT	2,170	-2,52	-26,34
EDP	3,447	-0,09	13,05
EDP R	9,240	0,43	18,84
GALP	13,190	-0,53	-4,39
IBERSOL	8,100	0,75	2,53
J MARTINS	14,415	-0,79	39,41
MOTA ENGIL	1,867	-2,61	15,96
NAVIGATOR	3,268	-1,57	-9,22
NOS	5,720	-0,87	8,03
NOVABASE	2,310	-3,75	14,36
PHAROL	0,154	-2,77	-5,39
RAMADA	7,540	-0,26	0,53
REN	12,200	-1,93	-6,87
SEMAPA	0,757	-2,45	-10,84
SONAE CAP.	0,888	-1,88	9,63
SONAE SGPS	7,540	-0,26	0,53

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	0,75
EDP R	0,43
BCP	-2,58
MOTA ENGIL	-2,61
PHAROL	-2,77
ALTRI	-2,79
NOVABASE	-3,75



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.138,16	-1,08%	8,60%	5.701,90	4.551,84
CAC40	5.363,24	-0,23%	13,37%	5.601,38	4.555,99
ESTX 50 PR	3.377,38	-0,39%	12,53%	3.540,64	2.908,70
XTRA DAX	12.095,44	-0,60%	14,55%	13.170,05	10.279,20
S&P 500	2.886,57	-0,17%	15,15%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.195,00	-0,56%	7,67%	9.985,90	8.286,20
NIKKEI 225	21.116,89	0,40%	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.