

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

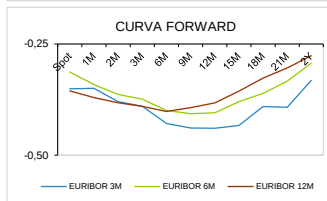
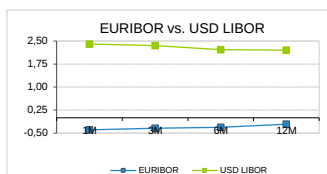
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

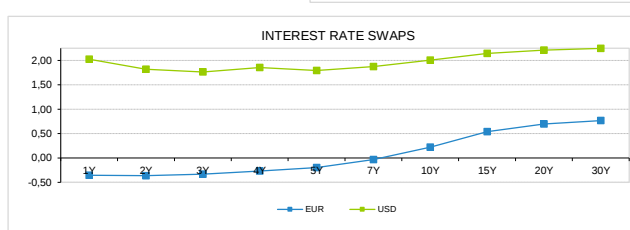
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3930	1	-2	1M	2,4044	0	-3	0,7225	-0,8084
3M	-0,3430	0	-3	3M	2,3493	1	-17	0,7749	-0,7222
6M	-0,3080	0	-7	6M	2,2201	0	-34	0,8599	-0,6798
12M	-0,2100	0	-6	12M	2,2021	4	-45	0,9624	-0,5776

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3555	-1	-9	-0,3832	-0,1042	0,2684
2Y	-0,3630	1	-12	-0,3298	-0,0085	0,3625
3Y	-0,3320	1	-14	-0,2552	0,0835	0,4588
4Y	-0,2690	1	-15	-0,1688	0,1755	0,5450
5Y	-0,1970	1	-17	-0,0815	0,2717	0,6235
7Y	-0,0320	1	-19	0,0994	0,4415	0,7546
10Y	0,2210	1	-22	0,3456	0,6384	0,8920
15Y	0,5380	1	-25	0,6183	0,8220	0,9875
20Y	0,6980	1	-26	0,7447	0,8823	0,9863
30Y	0,7660	1	-27	0,7797	0,8580	0,9130

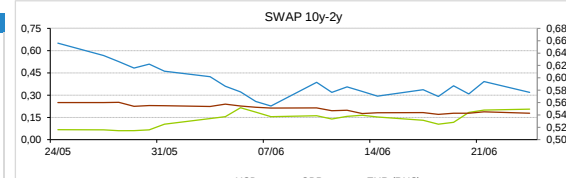
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,25
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,0240	-11	-44	1,5571	1,7187	1,9970
2Y	1,8190	9	-50	1,5360	1,7920	2,0290
3Y	1,7630	9	-49	1,5890	1,8250	2,0760
4Y	1,8530	-7	-40	1,6686	1,8875	2,1335
5Y	1,7930	10	-45	1,7317	1,9460	2,1959
7Y	1,8740	9	-42	1,8210	2,0430	2,2275
10Y	2,0040	9	-39	1,9943	2,1455	2,2810
15Y	2,1450	8	-36	2,1273	2,2240	2,3250
20Y	2,2120	7	-35	2,1600	2,2590	2,3220
30Y	2,2470	7	-33	2,2185	2,2580	2,2940

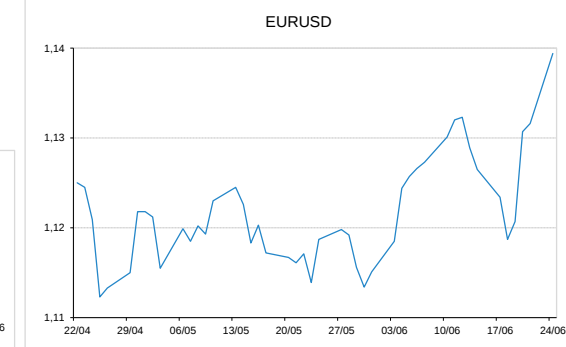
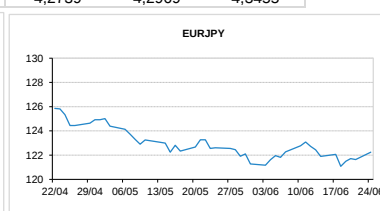


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,36	-0,84	-3,11	OT 2Y	-0,401	-0,04	-1,40
JETFUEL	620,59	-5,66	-19,32	OT 5Y	-0,115	-0,03	-14,40
DIESEL	583,34	-7,41	-26,82	OT 10Y	0,525	-0,06	-48,80
COBRE	5.959,50	-20,00	-25,00	BUND 10Y	-0,895	-2,75	-20,50
ZINCO	2.489,50	-31,00	-117,00	SCHATZ 2Y	-0,119	-0,91	-10,30
OURO	1.413,37	19,06	128,79	T-NOTE 10Y	2,779	-4,36	-24,40
TRIGO	539,00	8,25	42,25	T-NOTE 2Y	2,053	-5,74	-35,10
LICENÇA C02	26,40	1,10	0,93	GILT 10Y	0,811	-3,50	-15,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1394	0,69%	1,85%	1,1475	1,1548	1,1688
EUR/GBP	0,89365	0,07%	-1,17%	0,8965	0,8995	0,9060
EUR/JPY	122,25	-0,50%	0,29%	122,25	122,25	122,25
EUR/CHF	1,1077	0,23%	1,35%	1,1065	1,1054	1,1030
EUR/BRL	4,3539	-0,19%	3,57%	4,4213	4,4813	4,6003
EUR/PLN	4,2527	0,04%	0,87%	4,2739	4,2969	4,3455



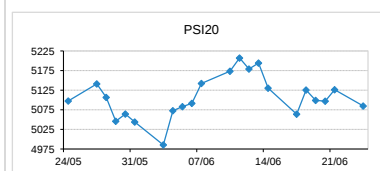
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1394	0,8937	122,25	1,1077	10,5905	7,4662	1,5029	1,63571	4,3539	9,6718
USD	0,8779	-	0,7858	107,375	0,9719	9,3037	6,5550	1,3206	1,4379	3,8208	8,4918

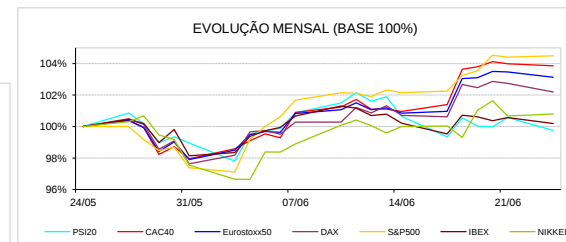
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,550	1,19	-4,31
BCP	0,260	-0,08	13,12
CORT. AMORIM	10,560	0,00	17,33
CTT	2,094	-1,87	-28,92
EDP	3,370	-0,74	10,53
EDP R	8,980	-1,43	15,50
GALP	13,330	-0,74	-3,37
IBERSOL	8,100	0,50	2,53
J MARTINS	14,240	-0,35	37,72
MOTA ENIGL	1,849	-1,65	14,84
NAVIGATOR	3,232	-0,55	-10,22
NOS	5,820	0,34	9,92
NOVABASE	2,250	0,00	11,39
PHAROL	0,150	-0,79	-8,09
RAMADA	7,140	2,59	-4,80
REN	12,320	-1,75	-5,95
SEMAPA	0,698	2,95	-17,79
SONAE CAP.	0,846	-0,35	4,38
SONAE SGPS	7,140	2,59	-4,80

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
SEMAPA	2,95
RAMADA	2,59
RAMADA	2,59
ALTRI	1,19
IBERSOL	0,50
PHAROL	-0,79
EDP R	-1,43
MOTA ENIGL	-1,65
REN	-1,75
CTT	-1,87



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.084,74	-0,81%	7,47%	5.686,45	4.551,84
CAC40	5.521,71	-0,12%	16,72%	5.601,38	4.555,99
ESTX 50 PR	3.455,57	-0,33%	15,13%	3.536,87	2.908,70
XTRA DAX	12.274,57	-0,53%	16,25%	12.886,83	10.279,20
S&P 500	2.953,14	0,09%	17,80%	2.964,15	2.346,58
IBEX 35	9.192,50	-0,38%	7,64%	9.971,60	8.286,20
NIKKEI 225	21.285,99	0,13%	6,35%	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.