

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

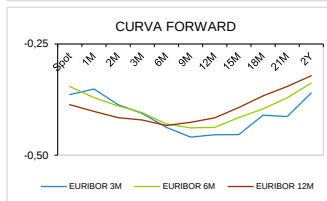
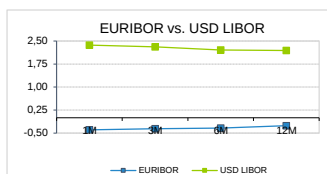
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

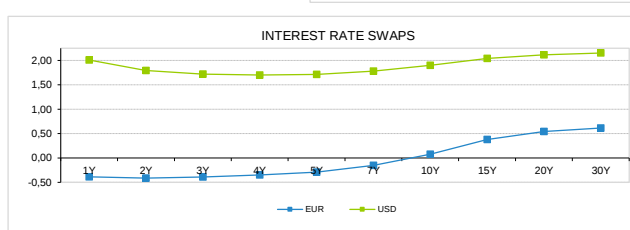
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3930	0	-1	1M	2,3665	0	-5	0,7223	-0,8110
3M	-0,3560	0	-4	3M	2,3114	1	-16	0,7618	-0,7446
6M	-0,3380	1	-8	6M	2,2098	1	-20	0,8175	-0,7072
12M	-0,2580	1	-8	12M	2,1916	1	-19	0,8755	-0,6008

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3870	0	-10	-0,4178	-0,1847	0,1340
2Y	-0,4130	0	-13	-0,3715	-0,1054	0,2220
3Y	-0,3900	0	-15	-0,3091	-0,0240	0,3130
4Y	-0,3470	-1	-16	-0,2382	0,0590	0,3990
5Y	-0,2890	-1	-18	-0,1625	0,1460	0,4740
7Y	-0,1520	-2	-20	-0,0018	0,3080	0,6010
10Y	0,0760	-3	-23	0,2290	0,4984	0,7410
15Y	0,3780	-4	-24	0,4913	0,6823	0,8499
20Y	0,5410	-4	-24	0,6254	0,7540	0,8563
30Y	0,6140	-4	-25	0,6672	0,7373	0,7888

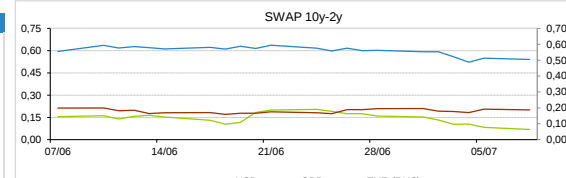
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,0090	1	-38	1,7146	1,7370	1,9425
2Y	1,7930	-3	-17	1,6725	1,7887	2,0030
3Y	1,7200	-3	-17	1,6630	1,8280	2,0530
4Y	1,7010	-4	-19	1,7452	1,8770	2,0950
5Y	1,7140	-4	-20	1,7879	1,9360	2,1563
7Y	1,7800	-5	-20	1,8774	2,0260	2,2010
10Y	1,8980	-6	-19	1,9825	2,1270	2,2590
15Y	2,0420	-6	-17	2,1100	2,2080	2,2970
20Y	2,1140	-7	-16	2,1650	2,2565	2,3210
30Y	2,1520	-6	-15	2,2085	2,2518	2,2911

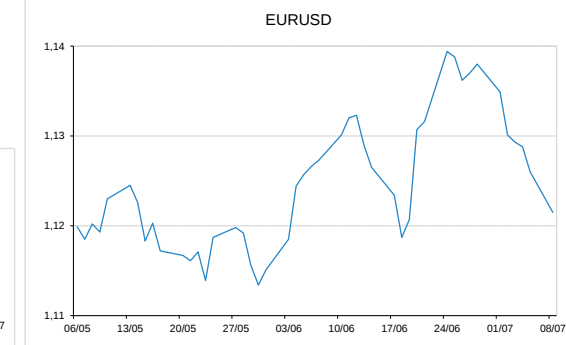
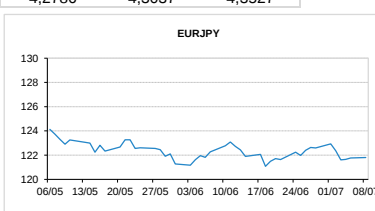


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,53	0,30	2,35	OT 2Y	-0,443	0,02	-7,10
JETFUEL	619,92	2,75	21,50	OT 5Y	-0,163	0,04	-8,10
DIESEL	585,17	1,75	19,25	OT 10Y	0,492	0,06	-18,20
COBRE	5.898,00	-18,00	95,00	BUND 10Y	-0,965	-2,11	-14,40
ZINCO	2.408,00	-26,50	-97,00	SCHATZ 2Y	-0,121	0,46	-8,40
OURO	1.396,20	-3,14	52,99	T-NOTE 10Y	2,820	-0,78	-6,00
TRIGO	508,00	-7,00	-1,50	T-NOTE 2Y	2,243	0,00	6,00
LICENÇA C02	26,78	0,40	2,27	GILT 10Y	0,700	-3,91	-12,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1215	-0,40%	-0,76%	1,1298	1,1381	1,1527
EUR/GBP	0,89625	0,09%	-0,42%	0,8991	0,9022	0,9081
EUR/JPY	121,8	-0,02%	0,80%	121,80	121,80	121,80
EUR/CHF	1,1139	-0,06%	0,53%	1,1128	1,1116	1,1094
EUR/BRL	4,2701	0,54%	3,10%	4,3364	4,3963	4,5150
EUR/PLN	4,2567	-0,04%	0,14%	4,2786	4,3037	4,3527



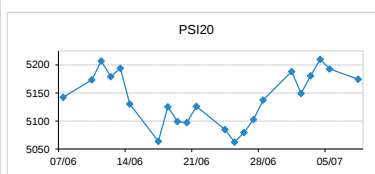
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1215	0,8963	121,80	1,1139	10,6061	7,4613	1,4678	1,60879	4,2701	9,6889
USD	0,8917	-	0,7991	108,66	0,9937	9,4567	6,6537	1,3096	1,4346	3,8109	8,6398

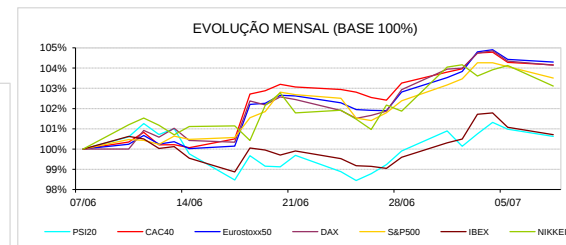
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,110	0,66	5,34
BCP	0,284	-1,05	23,62
CORT. AMORIM	10,140	-0,59	12,67
CTT	2,038	-1,16	-30,82
EDP	3,344	-1,09	9,68
EDP R	9,060	-0,66	16,53
GALP	13,390	0,68	-2,94
IBERSOL	8,100	-1,22	2,53
J MARTINS	14,380	1,41	39,07
MOTA ENGIL	1,906	-1,24	18,39
NAVIGATOR	3,342	0,06	-7,17
NOS	5,670	-1,73	7,08
NOVABASE	2,380	0,85	17,82
PHAROL	0,151	-0,26	-7,23
RAMADA	7,020	0,00	-6,40
REN	12,840	1,10	-1,98
SEMAPA	0,736	-0,81	-13,31
SONAE CAP.	0,860	-0,46	6,11
SONAE SGPS	7,020	0,00	-6,40

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
J MARTINS	1,41
REN	1,10
NOVABASE	0,85
GALP	0,68
ALTRI	0,66
EDP	-1,09
CTT	-1,16
IBERSOL	-1,22
MOTA ENGIL	-1,24
NOS	-1,73



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.174,59	-0,35%	9,37%	5.686,45	4.551,84
CAC40	5.586,92	-0,12%	18,10%	5.629,79	4.555,99
ESTX 50 PR	3.523,64	-0,12%	17,40%	3.549,26	2.908,70
XTRA DAX	12.544,06	-0,19%	18,80%	12.886,83	10.279,20
S&P 500	2.974,24	-0,54%	18,64%	2.995,84	2.346,58
IBEX 35	9.301,60	-0,36%	8,92%	9.971,60	8.286,20
NIKKEI 225	21.534,35	-0,98%	7,59%	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.