

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

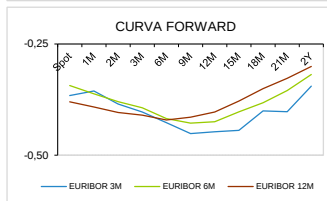
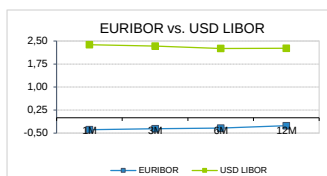
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

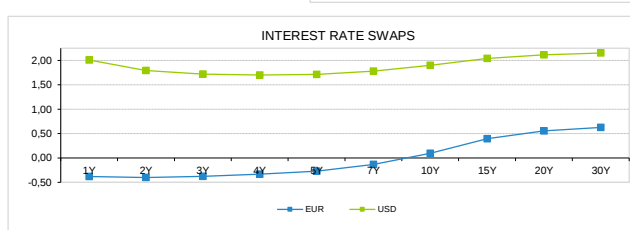
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3890	0	-1	1M	2,3794	1	-3	0,7215	-0,8126
3M	-0,3580	0	-4	3M	2,3378	3	-11	0,7626	-0,7484
6M	-0,3360	0	-8	6M	2,2565	5	-12	0,8223	-0,7058
12M	-0,2580	0	-8	12M	2,2615	7	-8	0,8830	-0,5950

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3808	1	-9	-0,4042	-0,1573	0,1790
2Y	-0,4010	1	-11	-0,3537	-0,0746	0,2660
3Y	-0,3760	1	-12	-0,2872	0,0105	0,3555
4Y	-0,3310	2	-13	-0,2129	0,0962	0,4425
5Y	-0,2720	2	-14	-0,1353	0,1835	0,5190
7Y	-0,1330	2	-16	0,0308	0,3484	0,6210
10Y	0,0960	2	-18	0,2649	0,5379	0,7835
15Y	0,3960	2	-19	0,5278	0,7209	0,8905
20Y	0,5560	2	-19	0,6613	0,7917	0,8965
30Y	0,6260	1	-21	0,7023	0,7729	0,8244

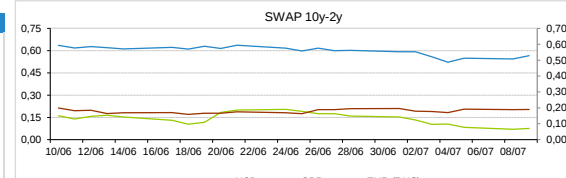
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,0090	1	-38	1,7323	1,7455	1,9635
2Y	1,7930	-3	-17	1,6950	1,7880	2,0197
3Y	1,7200	-3	-17	1,7105	1,8415	2,0710
4Y	1,7010	-4	-19	1,7395	1,9050	2,1339
5Y	1,7140	-4	-20	1,7850	1,9455	2,1759
7Y	1,7800	-5	-20	1,8625	2,0325	2,2200
10Y	1,8980	-6	-19	2,0025	2,1325	2,2760
15Y	2,0420	-6	-17	2,1270	2,2250	2,3130
20Y	2,1140	-7	-16	2,1820	2,2420	2,3394
30Y	2,1520	-6	-15	2,1880	2,2295	2,2615

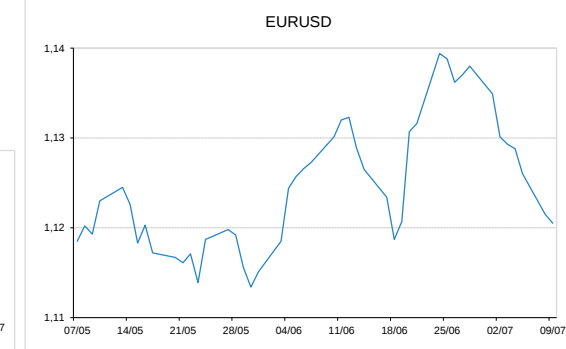
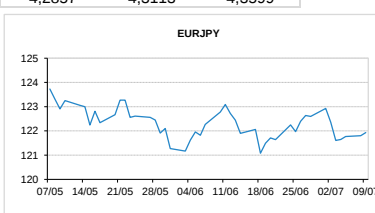
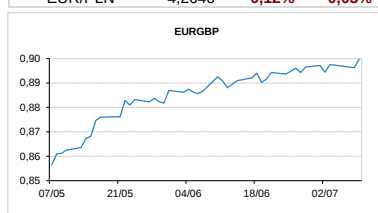


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,26	0,15	2,08	OT 2Y	-0,446	-0,01	-7,40
JETFUEL	619,92	2,75	21,50	OT 5Y	-0,170	0,00	-6,40
DIESEL	585,17	1,75	19,25	OT 10Y	0,473	-0,02	-15,10
COBRE	5.879,50	-10,00	93,00	BUND 10Y	-0,945	2,33	-9,90
ZINCO	2.371,50	-36,50	-150,50	SCHATZ 2Y	-0,117	0,69	-6,40
OURO	1.396,95	-0,04	53,74	T-NOTE 10Y	2,841	1,72	-1,10
TRIGO	502,25	-8,75	-7,25	T-NOTE 2Y	2,256	0,96	9,60
LICENÇA C02	26,63	-0,18	2,12	GILT 10Y	0,710	1,51	-9,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1205	-0,09%	-0,85%	1,1287	1,1372	1,1517
EUR/GBP	0,89975	-0,39%	-0,81%	0,9025	0,9057	0,9116
EUR/JPY	121,93	-0,11%	0,70%	121,93	121,93	121,93
EUR/CHF	1,1129	0,09%	0,61%	1,1118	1,1105	1,1085
EUR/BRL	4,266	0,13%	3,14%	4,3357	4,3937	4,5128
EUR/PLN	4,2640	-0,12%	-0,03%	4,2857	4,3113	4,3599



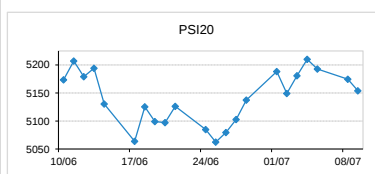
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1205	0,8998	121,93	1,1129	10,6176	7,4636	1,4709	1,61831	4,2660	9,6894
USD	0,8924	-	0,8024	108,79	0,9936	9,4764	6,6603	1,3132	1,4439	3,8020	8,6533

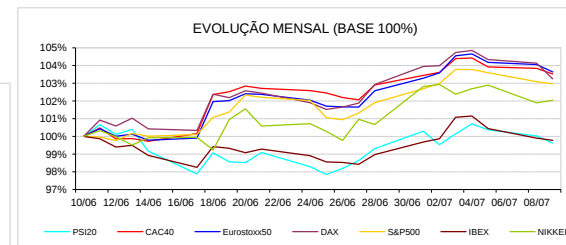
ACCIONISTA

TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,925	-2,95	2,16
BCP	0,281	-0,99	22,22
CORT. AMORIM	10,020	-1,38	11,33
CTT	2,018	-0,98	-31,50
EDP	3,376	0,78	10,72
EDP R	9,080	0,33	16,78
GALP	13,485	0,78	-2,25
IBERSOL	8,120	0,25	2,78
J MARTINS	14,320	-0,49	38,49
MOTA ENGIL	1,885	-1,21	17,08
NAVIGATOR	3,214	-3,71	-10,72
NOS	5,650	-0,35	6,70
NOVABASE	2,380	0,00	17,82
PHAROL	0,151	-0,53	-7,72
RAMADA	7,020	0,00	-6,40
REN	12,700	-0,78	-3,05
SEMAPA	0,744	1,09	-12,37
SONAE CAP.	0,854	-0,70	5,37
SONAE SGPS	7,020	0,00	-6,40

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SEMAPA	1,09
GALP	0,78
EDP	0,78
EDP R	0,33
IBERSOL	0,25
BCP	-0,99
MOTA ENGIL	-1,21
CORT. AMORIM	-1,38
ALTRI	-2,95
NAVIGATOR	-3,71



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.153,75	-0,40%	8,92%	5.686,45	4.551,84
CAC40	5.572,10	-0,31%	17,79%	5.629,79	4.555,99
ESTX 50 PR	3.509,75	-0,40%	16,94%	3.549,26	2.908,70
XTRA DAX	12.436,55	-0,85%	17,78%	12.886,83	10.279,20
S&P 500	2.972,29	-0,12%	18,56%	2.995,84	2.346,58
IBEX 35	9.273,90	-0,12%	8,59%	9.971,60	8.286,20
NIKKEI 225	21.565,15	0,14%	7,75%	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.