

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

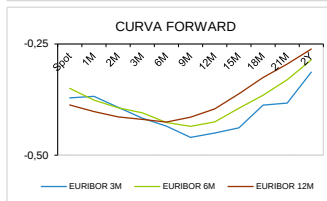
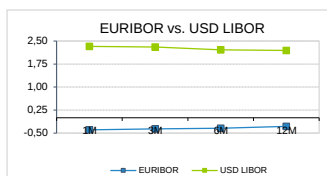
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

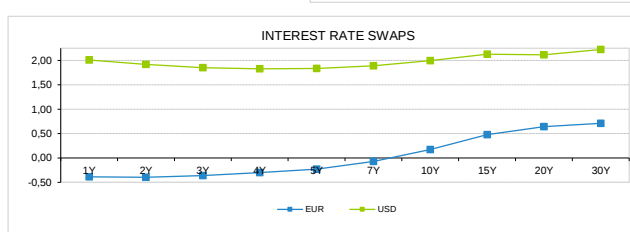
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3930	0	-2	1M	2,3250	-4	-9	0,7211	-0,8132
3M	-0,3630	0	-5	3M	2,3034	-4	-15	0,7703	-0,7448
6M	-0,3420	0	-8	6M	2,2126	-5	-14	0,8139	-0,7016
12M	-0,2800	0	-11	12M	2,1933	-9	-15	0,8919	-0,5862

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3875	0	-9	-0,3957	-0,0685	0,3232
2Y	-0,3960	-2	-10	-0,3283	0,0335	0,4202
3Y	-0,3600	-2	-9	-0,2420	0,1302	0,5144
4Y	-0,3010	-2	-9	-0,1480	0,2273	0,6000
5Y	-0,2290	-2	-9	-0,0540	0,3218	0,6838
7Y	-0,0710	-2	-10	0,1344	0,4959	0,8090
10Y	0,1740	-2	-12	0,3858	0,6895	0,9450
15Y	0,4790	-2	-13	0,6599	0,8735	1,0500
20Y	0,6420	-2	-14	0,7979	0,9434	1,0576
30Y	0,7110	-2	-15	0,8409	0,9231	0,9789

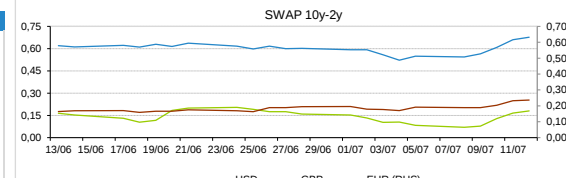
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,0090	1	-38	1,7446	1,8395	2,0735
2Y	1,9200	13	4	1,7362	1,8840	2,1330
3Y	1,8500	13	3	1,7696	1,9465	2,1855
4Y	1,8280	13	1	1,8197	2,0281	2,2523
5Y	1,8340	2	-1	1,8741	2,0615	2,2965
7Y	1,8910	11	-3	1,9550	2,1540	2,3345
10Y	1,9970	2	-5	2,0945	2,2555	2,3855
15Y	2,1280	9	-6	2,2180	2,3578	2,4240
20Y	2,1140	-7	-16	2,2780	2,3620	2,4250
30Y	2,2240	3	-7	2,3060	2,3590	2,3950

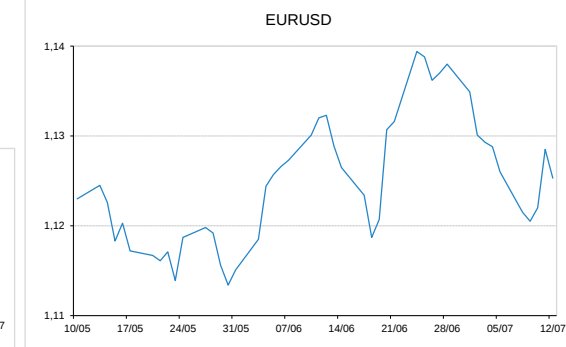
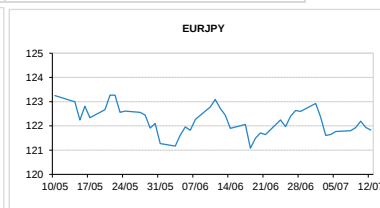
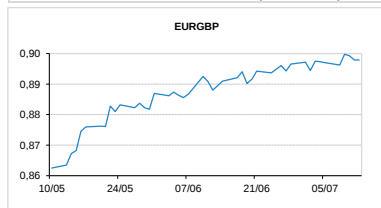


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	66,83	0,31	7,64	OT 2Y	-0,442	0,00	-13,40
JETFUEL	646,92	-5,83	56,83	OT 5Y	-0,067	0,03	-1,60
DIESEL	609,17	-4,83	52,83	OT 10Y	0,654	0,09	-0,30
COBRE	5.937,50	15,00	79,00	BUND 10Y	-0,837	1,52	-0,80
ZINCO	2.436,00	34,00	-120,50	SCHATZ 2Y	-0,108	0,00	-4,60
OURO	1.408,48	-2,35	75,86	T-NOTE 10Y	2,877	0,16	0,10
TRIGO	521,75	0,25	-9,25	T-NOTE 2Y	2,227	-0,38	2,70
LICENÇA C02	28,75	0,46	3,93	GILT 10Y	0,830	0,00	-3,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1253	-0,28%	-0,62%	1,1335	1,1417	1,1561
EUR/GBP	0,89788	0,00%	-1,09%	0,9007	0,9038	0,9099
EUR/JPY	121,83	0,09%	0,73%	121,83	121,83	121,83
EUR/CHF	1,1082	0,53%	1,45%	1,1070	1,1057	1,1036
EUR/BRL	4,2159	0,23%	3,57%	4,2813	4,3418	4,4613
EUR/PLN	4,2689	-0,05%	-0,28%	4,2907	4,3155	4,3645



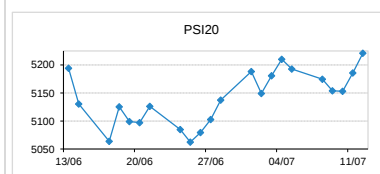
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1253	0,8979	121,83	1,1082	10,5508	7,4666	1,4677	1,60629	4,2159	9,6204
USD	0,8888	-	0,7962	108,025	0,9854	9,3842	6,6364	1,3045	1,4281	3,7464	8,5520

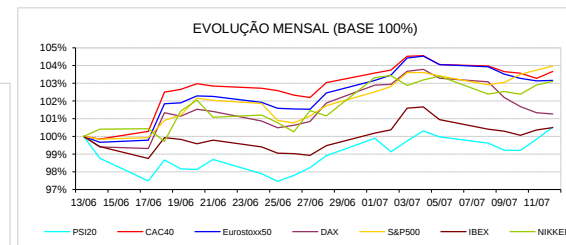
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,975	1,44	3,02
BCP	0,284	0,28	23,83
CORT. AMORIM	9,920	0,51	10,22
CTT	2,038	1,90	-30,82
EDP	3,382	0,36	10,92
EDP R	9,100	0,55	17,04
GALP	13,950	0,58	1,12
IBERSOL	8,160	0,49	3,29
J MARTINS	14,660	1,56	41,78
MOTA ENGIL	1,932	1,90	20,00
NAVIGATOR	3,204	0,13	-11,00
NOS	5,750	-0,09	8,59
NOVABASE	2,320	-0,85	14,85
PHAROL	0,151	0,53	-7,35
RAMADA	7,040	0,86	-6,13
REN	12,320	0,65	-5,95
SEMAPA	0,732	-1,08	-13,78
SONAE CAP.	0,875	2,52	7,96
SONAE SGPS	7,040	0,86	-6,13

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE CAP.	2,52
CTT	1,90
MOTA ENGIL	1,90
J MARTINS	1,56
ALTRI	1,44
NOS	-0,09
NOVABASE	-0,85
SEMAPA	-1,08



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.221,17	0,68%	10,35%	5.661,87	4.551,84
CAC40	5.572,86	0,38%	17,80%	5.629,79	4.555,99
ESTX 50 PR	3.497,63	0,03%	16,53%	3.549,26	2.908,70
XTRA DAX	12.323,32	-0,07%	16,71%	12.886,83	10.279,20
S&P 500	3.006,52	0,22%	19,93%	3.006,95	2.346,58
IBEX 35	9.293,20	0,14%	8,82%	9.924,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.685,90	0,20%	8,35%	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.