

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

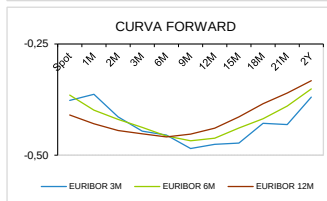
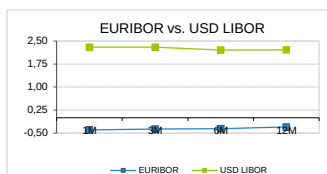
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

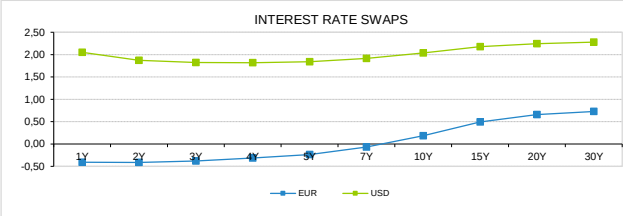
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3970	0	-1	1M	2,3004	-1	-8	0,7195	-0,8140
3M	-0,3690	0	-5	3M	2,2996	0	-10	0,7665	-0,7484
6M	-0,3570	-1	-9	6M	2,2070	-1	-7	0,8040	-0,7152
12M	-0,2980	-1	-12	12M	2,2109	0	-4	0,8766	-0,6090

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4095	-1	-11	-0,4401	-0,1740	0,1970
2Y	-0,4130	-1	-9	-0,3857	-0,0850	0,2935
3Y	-0,3790	-2	-8	-0,3146	0,0100	0,3865
4Y	-0,3130	-2	-7	-0,2341	0,1040	0,4740
5Y	-0,2360	-2	-6	-0,1470	0,1980	0,5510
7Y	-0,0680	-3	-6	0,0325	0,3670	0,6780
10Y	0,1830	-3	-6	0,2750	0,5626	0,8130
15Y	0,4930	-4	-7	0,5466	0,7498	0,9180
20Y	0,6570	-4	-7	0,6800	0,8155	0,9210
30Y	0,7270	-5	-7	0,7198	0,7959	0,8500

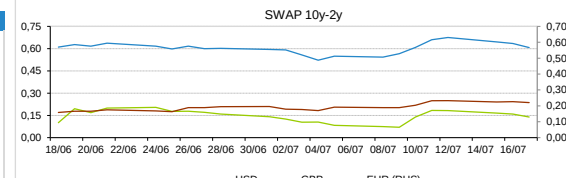
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,0510	-2	-3	1,6942	1,7807	1,9985
2Y	1,8710	-2	0	1,6953	1,8190	2,0715
3Y	1,8220	-2	1	1,7241	1,8830	2,1196
4Y	1,8180	-1	-4	1,7460	1,9340	2,1644
5Y	1,8400	-2	1	1,7950	2,0038	2,2080
7Y	1,9150	-3	1	1,8930	2,0958	2,2677
10Y	2,0380	-3	1	2,0210	2,1896	2,3218
15Y	2,1770	-3	1	2,1440	2,2684	2,3602
20Y	2,2450	-3	1	2,2010	2,2959	2,3582
30Y	2,2790	-3	1	2,2427	2,2902	2,3020

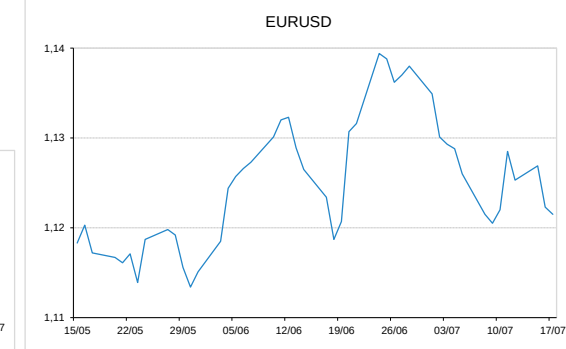
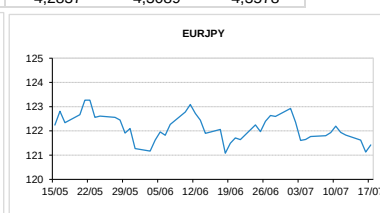


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,28	-0,07	4,29	OT 2Y	-0,486	-0,01	-16,30
JETFUEL	626,67	-16,83	29,42	OT 5Y	-0,173	-0,03	-13,40
DIESEL	585,92	-19,08	24,42	OT 10Y	0,511	-0,04	-13,00
COBRE	5.960,00	29,00	190,00	BUND 10Y	-0,929	-4,06	-9,70
ZINCO	2.486,00	38,00	20,00	SCHATZ 2Y	-0,126	-1,14	-5,70
OURO	1.422,90	13,69	83,14	T-NOTE 10Y	2,851	-3,13	0,50
TRIGO	507,25	-0,25	-35,50	T-NOTE 2Y	2,227	-1,54	4,00
LICENÇA C02	28,50	0,03	3,48	GILT 10Y	0,754	-5,81	-9,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1215	-0,07%	-0,17%	1,1298	1,1381	1,1525
EUR/GBP	0,9034	-0,09%	-1,25%	0,9063	0,9094	0,9154
EUR/JPY	121,42	-0,24%	0,53%	121,42	121,42	121,42
EUR/CHF	1,1085	-0,05%	1,14%	1,1073	1,1060	1,1039
EUR/BRL	4,2238	0,04%	3,27%	4,2904	4,3523	4,4741
EUR/PLN	4,2616	-0,08%	0,00%	4,2837	4,3089	4,3578



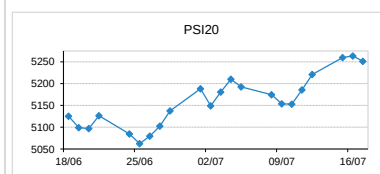
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1215	0,9034	121,42	1,1085	10,5073	7,4675	1,4648	1,5996	4,2238	9,6222
USD	0,8908	-	0,8045	108,095	0,9879	9,3648	6,6524	1,3060	1,4274	3,7659	8,5762

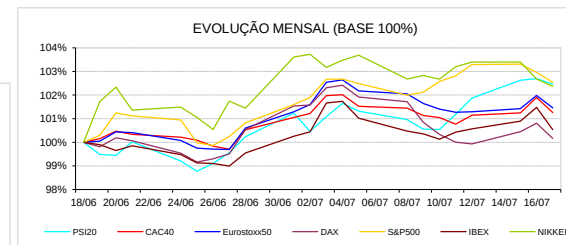
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,005	-0,58	3,53
BCP	0,286	-0,90	24,75
CORT. AMORIM	9,860	-0,20	9,56
CTT	2,026	-1,65	-31,23
EDP	3,370	0,00	10,53
EDP R	9,200	0,77	18,33
GALP	14,020	0,11	1,63
IBERSOL	8,100	0,00	2,53
J MARTINS	14,910	0,24	44,20
MOTA ENGIL	1,925	-1,94	19,57
NAVIGATOR	3,194	-1,42	-11,28
NOS	5,790	0,52	9,35
NOVABASE	2,370	0,00	17,33
PHAROL	0,157	-0,38	-3,68
RAMADA	6,960	-0,57	-7,20
REN	12,260	-1,29	-6,41
SEMAPA	0,728	0,14	-14,25
SONAE CAP.	0,895	-1,05	10,49
SONAE SGPS	6,960	-0,57	-7,20

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP R	0,77
NOS	0,52
J MARTINS	0,24
SEMAPA	0,14
GALP	0,11
SONAE CAP.	-1,05
REN	-1,29
NAVIGATOR	-1,42
CTT	-1,65
MOTA ENGIL	-1,94



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.252,28	-0,21%	11,01%	5.655,02	4.551,84
CAC40	5.571,71	-0,76%	17,79%	5.629,79	4.555,99
ESTX 50 PR	3.501,58	-0,56%	16,66%	3.549,26	2.908,70
XTRA DAX	12.341,03	-0,72%	16,88%	12.886,83	10.279,20
S&P 500	2.995,79	-0,28%	19,49%	3.017,80	2.346,58
IBEX 35	9.284,20	-0,99%	8,72%	9.924,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.469,18	-0,31%	7,27%	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.