

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

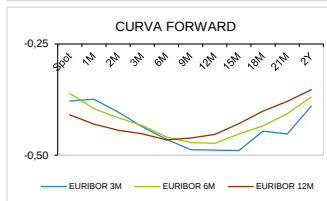
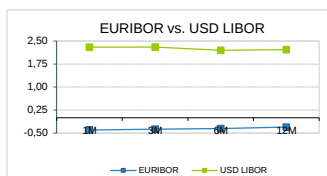
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

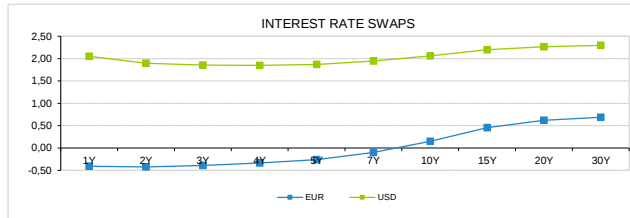
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3990	0	-1	1M	2,2979	0	-9	0,7190	-0,8150
3M	-0,3700	0	-5	3M	2,3025	0	-12	0,7665	-0,7478
6M	-0,3530	0	-8	6M	2,1988	-1	-11	0,8020	-0,7170
12M	-0,3030	-1	-12	12M	2,2170	1	-7	0,8756	-0,6112

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4097	0	-7	-0,4532	-0,1870	0,1783
2Y	-0,4240	-1	-10	-0,4029	-0,0965	0,2740
3Y	-0,3920	-1	-10	-0,3305	-0,0034	0,3685
4Y	-0,3330	-2	-9	-0,2503	0,0899	0,4560
5Y	-0,2600	-2	-9	-0,1636	0,1829	0,5340
7Y	-0,0980	-3	-9	0,0153	0,3519	0,6630
10Y	0,1480	-4	-10	0,2593	0,5497	0,8050
15Y	0,4560	-4	-11	0,5338	0,7378	0,9130
20Y	0,6180	-4	-11	0,6720	0,8098	0,9180
30Y	0,6880	-4	-11	0,7153	0,7923	0,8467

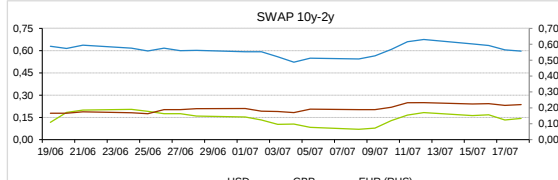
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,0510	-2	-3	1,6721	1,7539	1,9825
2Y	1,8970	3	3	1,6360	1,7940	2,0370
3Y	1,8530	3	4	1,6705	1,8560	2,0860
4Y	1,8490	3	0	1,7150	1,9347	2,1547
5Y	1,8700	3	4	1,7670	1,9881	2,2004
7Y	1,9440	3	4	1,8908	2,0845	2,2370
10Y	2,0630	3	3	2,0010	2,1823	2,3201
15Y	2,1980	2	3	2,1515	2,2400	2,3300
20Y	2,2640	2	3	2,2117	2,2680	2,3310
30Y	2,2960	2	2	2,2379	2,2884	2,3050

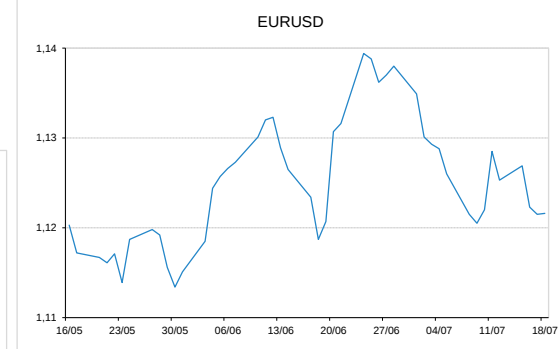
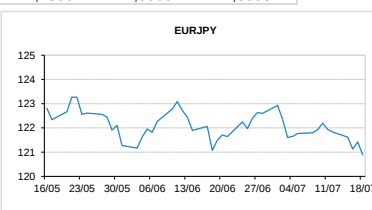
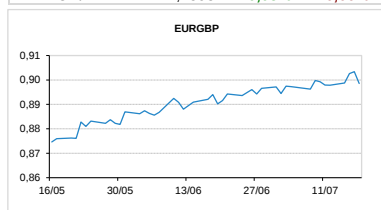


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	61,82	-1,84	0,49	OT 2Y	-0,504	-0,02	-10,60
JETFUEL	612,67	-14,00	11,01	OT 5Y	-0,204	-0,03	-5,80
DIESEL	573,17	-12,75	7,17	OT 10Y	0,472	-0,04	-5,90
COBRE	5.982,50	-32,00	135,00	BUND 10Y	-0,950	-2,32	-2,80
ZINCO	2.479,00	-7,00	-6,00	SCHATZ 2Y	-0,130	-0,23	0,70
OURO	1.428,10	5,77	80,06	T-NOTE 10Y	2,830	-0,78	0,60
TRIGO	498,00	-7,50	-37,50	T-NOTE 2Y	2,199	-1,92	1,40
LICENÇA C02	27,78	-0,69	2,66	GILT 10Y	0,749	-0,62	-4,50



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1216	0,01%	0,26%	1,1297	1,1380	1,1524
EUR/GBP	0,89853	0,54%	-0,50%	0,9013	0,9045	0,9105
EUR/JPY	120,89	0,44%	0,16%	120,89	120,89	120,89
EUR/CHF	1,1073	0,11%	1,13%	1,1061	1,1048	1,1026
EUR/BRL	4,2055	0,47%	2,74%	4,2705	4,3318	4,4532
EUR/PLN	4,2593	0,05%	0,00%	4,2806	4,3060	4,3553



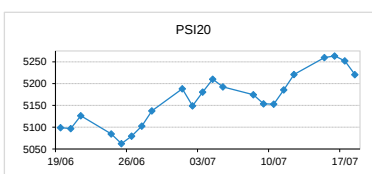
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1216	0,8985	120,89	1,1073	10,5000	7,4667	1,4693	1,59413	4,2055	9,6436
USD	0,8915	-	0,8012	107,83	0,9872	9,3557	6,6565	1,3092	1,4206	3,7498	8,6019

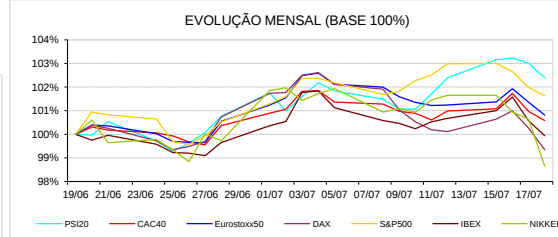
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,920	-1,42	2,07
BCP	0,280	-2,17	22,05
CORT. AMORIM	9,800	-0,61	8,89
CTT	2,020	-0,30	-31,43
EDP	3,387	0,50	11,09
EDP R	9,220	0,22	18,59
GALP	13,940	-0,57	1,05
IBERSOL	8,040	-0,74	1,77
J MARTINS	14,825	-0,57	43,38
MOTA ENGIL	1,889	-1,87	17,33
NAVIGATOR	3,162	-1,00	-12,17
NOS	5,785	-0,09	9,25
NOVABASE	2,350	-0,84	16,34
PHAROL	0,155	-1,65	-5,27
RAMADA	6,960	0,00	-7,20
REN	12,200	-0,49	-6,87
SEMAPA	0,722	-0,82	-14,96
SONAE CAP.	0,886	-1,06	9,32
SONAE SGPS	6,960	0,00	-7,20

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP	0,50
EDP R	0,22
SONAE CAP.	-1,06
ALTRI	-1,42
PHAROL	-1,65
MOTA ENGIL	-1,87
BCP	-2,17



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.220,59	-0,60%	10,34%	5.655,02	4.551,84
CAC40	5.550,55	-0,38%	17,33%	5.629,79	4.555,99
ESTX 50 PR	3.482,83	-0,54%	16,04%	3.549,26	2.908,70
XTRA DAX	12.227,85	-0,92%	15,81%	12.886,83	10.279,20
S&P 500	2.974,37	-0,34%	18,64%	3.017,80	2.346,58
IBEX 35	9.225,70	-0,63%	8,03%	9.924,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.046,24	-1,97%	5,15%	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.