

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

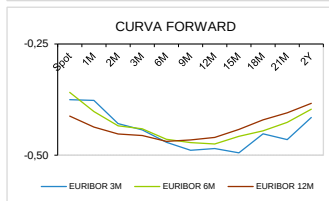
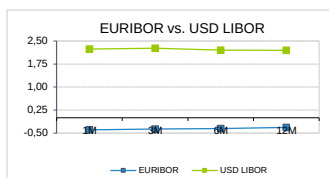
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

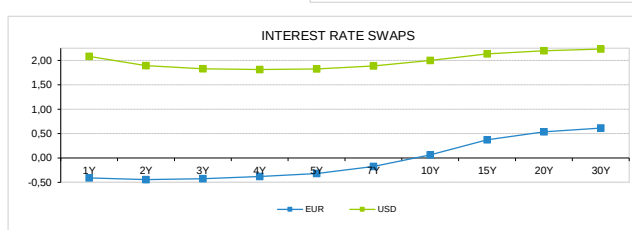
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,3940	0	-1	1M	2,2370	0	-17	0,7163
3M	-0,3670	0	-2	3M	2,2658	1	-6	0,7833
6M	-0,3510	1	-4	6M	2,2049	3	1	0,8119
12M	-0,3140	0	-10	12M	2,1966	2	1	0,8621
								-0,6256

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4110	1	-4	-0,4599	-0,2510	0,0785
2Y	-0,4440	2	-7	-0,4222	-0,1700	0,1675
3Y	-0,4260	2	-9	-0,3660	-0,0860	0,2570
4Y	-0,3790	2	-10	-0,2958	0,0023	0,3460
5Y	-0,3180	2	-10	-0,2205	0,0896	0,4168
7Y	-0,1740	2	-12	-0,0571	0,2518	0,5451
10Y	0,0620	2	-13	0,1738	0,4410	0,6886
15Y	0,3710	2	-13	0,4349	0,6255	0,7985
20Y	0,5360	3	-12	0,5705	0,6993	0,8083
30Y	0,6130	3	-11	0,6192	0,6913	0,7462

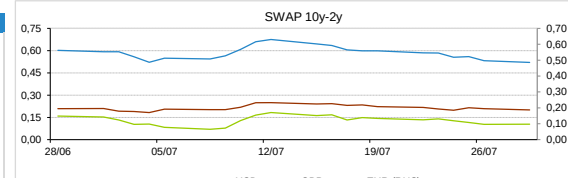
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,0840	1	9	1,6786	1,7300	1,9565
2Y	1,8940	2	12	1,6776	1,7840	2,0003
3Y	1,8280	1	11	1,6999	1,8400	2,0540
4Y	1,8140	1	10	1,7363	1,8940	2,1218
5Y	1,8240	1	8	1,7820	1,9627	2,1666
7Y	1,8870	0	6	1,8776	2,0330	2,2035
10Y	1,9990	0	4	1,9880	2,1310	2,2680
15Y	2,1330	0	3	2,1095	2,2140	2,3005
20Y	2,1990	0	3	2,1750	2,2415	2,3360
30Y	2,2330	0	2	2,1940	2,2390	2,2725

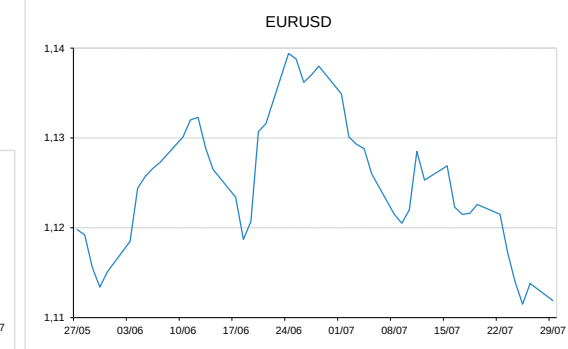
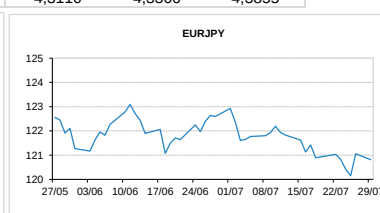


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	63,25	-0,21	-1,49	OT 2Y	-0,554	0,00	-13,40
JETFUEL	627,00	-4,00	-15,00	OT 5Y	-0,230	-0,01	-7,70
DIESEL	588,50	-4,50	-15,25	OT 10Y	0,418	-0,02	-6,40
COBRE	5.966,00	-44,00	-25,00	BUND 10Y	-1,032	-1,56	-12,40
ZINCO	2.439,00	0,00	-89,00	SCHATZ 2Y	-0,133	-1,14	-1,20
OURO	1.421,02	2,32	11,42	T-NOTE 10Y	2,834	-1,87	5,30
TRIGO	501,50	5,50	-25,75	T-NOTE 2Y	2,247	-2,30	15,20
LICENÇA C02	28,38	0,09	2,10	GILT 10Y	0,642	-3,44	-17,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1119	-0,17%	-2,03%	1,1201	1,1286	1,1433
EUR/GBP	0,9044	-0,89%	-0,80%	0,9072	0,9103	0,9162
EUR/JPY	120,81	0,21%	1,75%	120,81	120,81	120,81
EUR/CHF	1,1047	0,07%	0,93%	1,1035	1,1023	1,1001
EUR/BRL	4,2221	-0,41%	2,72%	4,2863	4,3474	4,4726
EUR/PLN	4,2893	-0,46%	-1,15%	4,3110	4,3366	4,3855



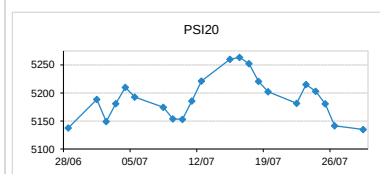
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1119	0,9044	120,81	1,1047	10,5707	7,4664	1,4655	1,61283	4,2221	9,6964
USD	0,8984	-	0,8179	108,795	0,9926	9,4867	6,7079	1,3170	1,4498	3,7903	8,7042

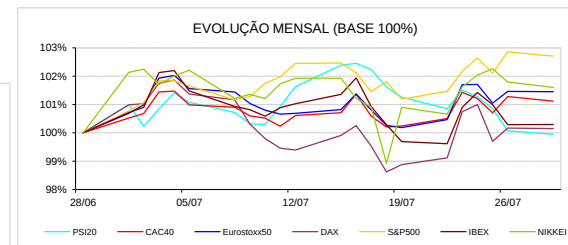
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,095	-0,57	5,09
BCP	0,251	-0,20	9,15
CORT. AMORIM	9,700	1,46	7,78
CTT	2,000	-0,99	-32,11
EDP	3,381	0,57	10,89
EDP R	9,350	1,08	20,26
GALP	14,150	0,53	2,57
IBERSOL	8,060	0,00	2,03
J MARTINS	14,725	-0,91	42,41
MOTA ENGIL	1,881	-1,05	16,83
NAVIGATOR	3,156	-2,17	-12,33
NOS	5,765	-0,60	8,88
NOVABASE	2,670	-0,74	32,18
PHAROL	0,151	-1,31	-7,48
RAMADA	6,700	-2,05	-10,67
REN	12,260	-1,76	-6,41
SEMAPA	0,711	-0,14	-16,25
SONAE CAP.	0,855	-1,10	5,56
SONAE SGPS	6,700	-2,05	-10,67

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	1,46
EDP R	1,08
EDP	0,57
GALP	0,53
PHAROL	-1,31
REN	-1,76
RAMADA	-2,05
RAMADA	-2,05
NAVIGATOR	-2,17



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.134,84	-0,13%	8,53%	5.651,42	4.551,84
CAC40	5.601,10	-0,16%	18,40%	5.672,77	4.555,99
ESTX 50 PR	3.524,04	-0,01%	17,41%	3.573,57	2.908,70
XTRA DAX	12.417,47	-0,02%	17,60%	12.886,83	10.279,20
S&P 500	3.021,18	-0,14%	20,53%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	9.215,40	0,01%	8,03%	9.924,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.616,80	-0,19%	8,00%	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.