

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

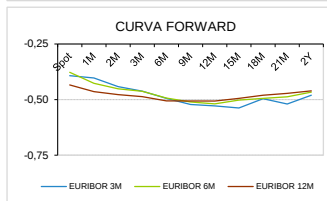
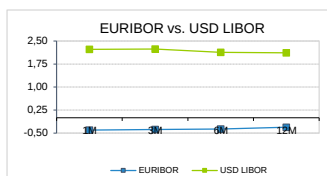
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

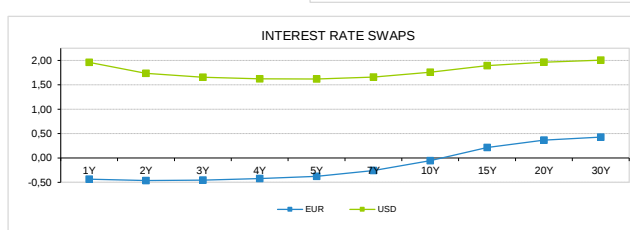
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4010	-1	-1	1M	2,2285	-2	-15	0,7114	-0,8160
3M	-0,3840	0	-2	3M	2,2393	-5	-7	0,7731	-0,7722
6M	-0,3690	0	-3	6M	2,1330	-9	-9	0,8114	-0,7562
12M	-0,3080	0	-4	12M	2,1159	-12	-9	0,8460	-0,6414

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4342	0	-5	-0,5062	-0,3470	-0,0697
2Y	-0,4630	-3	-6	-0,4845	-0,2771	0,0037
3Y	-0,4540	-3	-8	-0,4384	-0,2075	0,0816
4Y	-0,4230	-4	-10	-0,3775	-0,1350	0,1614
5Y	-0,3760	-5	-12	-0,3185	-0,0601	0,2200
7Y	-0,2590	-7	-16	-0,1818	0,0789	0,3326
10Y	-0,0550	-8	-21	0,0159	0,2466	0,4552
15Y	0,2140	-10	-27	0,2465	0,4079	0,5515
20Y	0,3660	-11	-29	0,3633	0,4697	0,5547
30Y	0,4280	-12	-31	0,3927	0,4492	0,4907

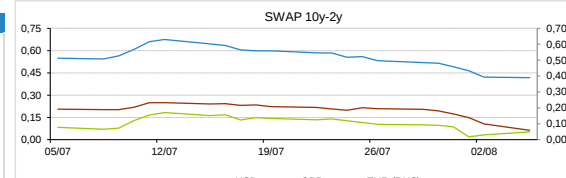
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,00
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,9610	-11	-5	1,4227	1,4295	1,6465
2Y	1,7370	-13	-8	1,3713	1,4670	1,6740
3Y	1,6540	-13	-10	1,3565	1,5238	1,7155
4Y	1,6220	-13	-12	1,4000	1,5823	1,7855
5Y	1,6190	-13	-14	1,4510	1,6320	1,8302
7Y	1,6580	-13	-17	1,5400	1,7225	1,8986
10Y	1,7570	-13	-20	1,6840	1,8125	1,9335
15Y	1,8930	-12	-21	1,7965	1,9020	1,9900
20Y	1,9650	-11	-22	1,8600	1,9340	1,9960
30Y	2,0050	-10	-20	1,9091	1,9516	1,9870

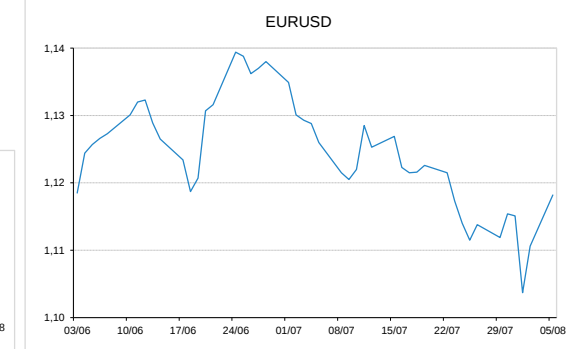
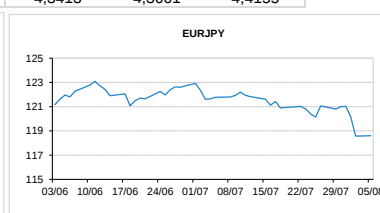
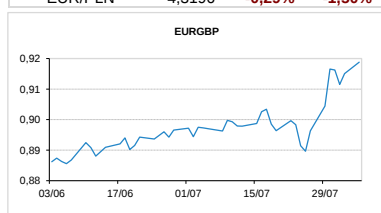


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	60,59	-1,30	-3,25	OT 2Y	-0,568	-0,01	-8,40
JETFUEL	616,25	-9,69	-4,82	OT 5Y	-0,238	0,01	1,90
DIESEL	583,25	-8,19	0,51	OT 10Y	0,283	-0,01	-5,20
COBRE	5.722,00	-169,50	-157,50	BUND 10Y	-1,150	-2,81	-16,10
ZINCO	2.348,50	-54,50	-139,50	SCHATZ 2Y	-0,178	-2,74	-3,80
OURO	1.460,74	13,74	61,40	T-NOTE 10Y	2,620	-6,91	-13,00
TRIGO	490,50	-0,25	-24,50	T-NOTE 2Y	2,030	-10,90	-10,00
LICENÇA C02	28,64	-0,62	2,26	GILT 10Y	0,504	-4,88	-16,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1182	0,68%	-0,69%	1,1261	1,1339	1,1471
EUR/GBP	0,9188	-0,41%	-2,37%	0,9217	0,9249	0,9309
EUR/JPY	118,61	-0,03%	2,66%	118,61	118,61	118,61
EUR/CHF	1,0892	0,19%	2,20%	1,0879	1,0864	1,0839
EUR/BRL	4,4109	-2,09%	-2,74%	4,4754	4,5353	4,6512
EUR/PLN	4,3196	-0,29%	-1,50%	4,3413	4,3661	4,4155



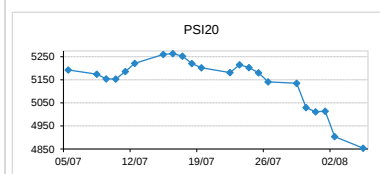
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1182	0,9188	118,61	1,0892	10,7580	7,4639	1,4768	1,65092	4,4109	9,9826
USD	0,8939	-	0,8233	106,045	0,9736	9,6294	6,6736	1,3211	1,4759	3,9413	8,9343

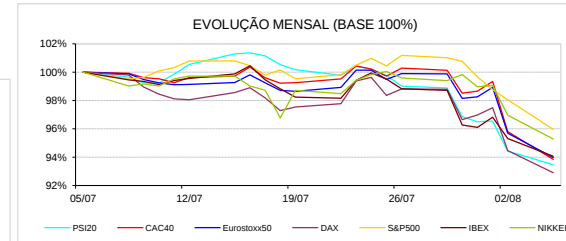
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,425	-1,09	-6,47
BCP	0,219	-1,67	-4,79
CORT. AMORIM	9,500	-0,94	5,56
CTT	1,896	0,21	-35,64
EDP	3,302	-0,63	8,30
EDP R	9,330	-0,85	20,00
GALP	13,310	-1,04	-3,52
IBERSOL	8,120	0,74	2,78
J MARTINS	14,030	-0,99	35,69
MOTA ENGIL	1,651	-5,01	2,55
NAVIGATOR	2,836	-2,14	-21,22
NOS	5,530	-1,25	4,44
NOVABASE	2,620	-0,77	29,70
PHAROL	0,146	-1,22	-10,78
RAMADA	6,200	-1,27	-17,33
REN	11,960	0,50	-8,70
SEMAPA	0,660	-3,79	-22,26
SONAE CAP.	0,808	-1,94	-0,25
SONAE SGPS	6,200	-1,27	-17,33

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOVABASE	0,77
IBERSOL	0,74
REN	0,50
CTT	0,21
BCP	-1,67
SONAE CAP.	-1,94
NAVIGATOR	-2,14
SEMAPA	-3,79
MOTA ENGIL	-5,01



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.853,48	-1,03%	2,58%	5.651,42	4.551,84
CAC40	5.249,37	-2,05%	10,96%	5.672,77	4.555,99
ESTX 50 PR	3.315,47	-1,80%	10,46%	3.573,57	2.908,70
XTRA DAX	11.676,57	-1,65%	10,58%	12.738,53	10.279,20
S&P 500	2.869,49	-2,13%	14,48%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	8.780,80	-1,31%	2,82%	9.813,60	8.286,20
NIKKEI 225	20.720,29	-1,74%	3,52%	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.