

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

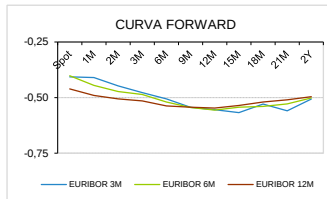
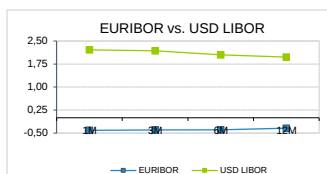
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

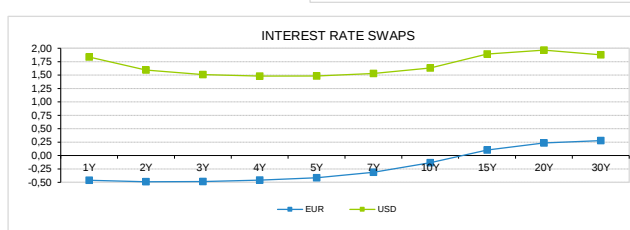
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4090	-1	-2	1M	2,2113	0	-16	0,7051	-0,8210
3M	-0,3980	-1	-4	3M	2,1845	0	-13	0,7710	-0,7864
6M	-0,3930	0	-6	6M	2,0476	0	-16	0,8008	-0,7746
12M	-0,3390	-2	-8	12M	1,9770	-2	-21	0,8349	-0,6664

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4610	0	-7	-0,5470	-0,3951	-0,1031
2Y	-0,4890	-2	-8	-0,5212	-0,3290	-0,0232
3Y	-0,4840	-2	-9	-0,4806	-0,2532	0,0544
4Y	-0,4580	-2	-11	-0,4260	-0,1760	0,1309
5Y	-0,4160	-2	-13	-0,3608	-0,0982	0,1930
7Y	-0,3120	-3	-16	-0,2190	0,0464	0,2865
10Y	-0,1330	-5	-21	-0,0159	0,2164	0,4336
15Y	0,1040	-7	-27	0,2199	0,3849	0,5289
20Y	0,2330	-7	-31	0,3367	0,4446	0,5333
30Y	0,2780	-8	-34	0,3694	0,4257	0,4690

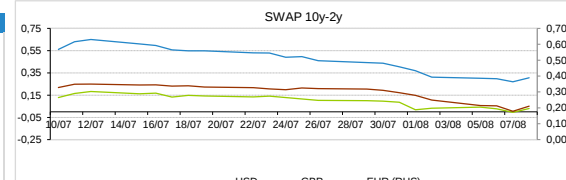
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,00
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,8350	-13	-17	1,3765	1,3999	1,5845
2Y	1,5930	-14	-20	1,3360	1,4255	1,6300
3Y	1,5090	-15	-21	1,3704	1,4760	1,6770
4Y	1,4810	-14	-22	1,3984	1,5414	1,7200
5Y	1,4820	-14	-23	1,4210	1,5730	1,7808
7Y	1,5300	-13	-25	1,5040	1,6610	1,8260
10Y	1,6320	-13	-27	1,6245	1,7610	1,8880
15Y	1,8930	-12	-21	1,7510	1,8500	1,9360
20Y	1,9650	-11	-22	1,8130	1,8992	1,9410
30Y	1,8770	-13	-28	1,8460	1,8890	1,9210

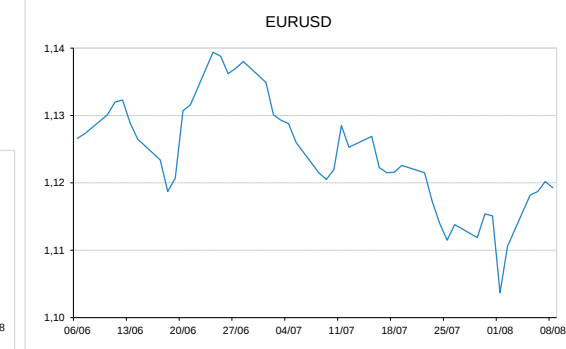
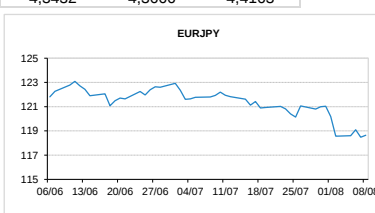


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	57,53	1,30	-6,29	OT 2Y	-0,598	-0,02	-15,20
JETFUEL	576,13	-22,95	-41,04	OT 5Y	-0,236	0,01	-6,60
DIESEL	541,88	-22,95	-41,54	OT 10Y	0,241	0,06	-23,20
COBRE	5.746,00	22,00	-197,00	BUND 10Y	-1,193	3,12	-24,90
ZINCO	2.258,00	-51,50	-150,00	SCHATZ 2Y	-0,217	0,91	-10,00
OURO	1.497,94	-7,16	100,95	T-NOTE 10Y	2,610	4,73	-23,40
TRIGO	501,75	13,50	-9,25	T-NOTE 2Y	2,044	4,96	-22,60
LICENÇA C02	28,56	0,28	1,75	GILT 10Y	0,515	4,34	-19,50



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1193	-0,08%	-0,20%	1,1270	1,1348	1,1479
EUR/GBP	0,92115	0,26%	-2,70%	0,9241	0,9273	0,9335
EUR/JPY	118,64	-0,13%	2,66%	118,64	118,64	118,64
EUR/CHF	1,0929	-0,18%	1,92%	1,0915	1,0901	1,0877
EUR/BRL	4,4108	0,83%	-3,15%	4,4741	4,5340	4,6554
EUR/PLN	4,3208	-0,01%	-1,44%	4,3432	4,3666	4,4163



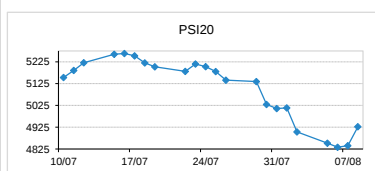
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1193	0,9212	118,64	1,0929	10,7342	7,4631	1,4843	1,64581	4,4108	9,9989
USD	0,8931	-	0,8244	106,22	0,9778	9,5982	6,6652	1,3278	1,4707	3,9367	8,9502

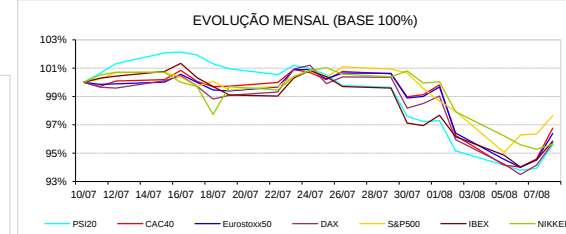
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,610	5,06	-3,28
BCP	0,219	2,48	-4,40
CORT. AMORIM	9,250	-1,07	2,78
CTT	1,903	2,31	-35,40
EDP	3,362	0,87	10,27
EDP R	9,630	1,16	23,86
GALP	13,250	2,28	-3,95
IBERSOL	8,180	0,00	3,54
J MARTINS	14,740	2,68	42,55
MOTA ENGIL	1,742	4,62	8,20
NAVIGATOR	2,888	2,27	-19,78
NOS	5,570	1,36	5,19
NOVABASE	2,620	1,55	29,70
PHAROL	0,146	0,55	-10,78
RAMADA	6,100	-1,29	-18,67
REN	11,980	1,53	-8,55
SEMAPA	0,641	-1,84	-24,50
SONAE CAP.	0,821	1,11	1,30
SONAE SGPS	6,100	-1,29	-18,67

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	5,06
MOTA ENGIL	4,62
J MARTINS	2,68
BCP	2,48
CTT	2,31
CORT. AMORIM	-1,07
RAMADA	-1,29
SEMAPA	-1,84



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.927,22	1,80%	4,14%	5.651,42	4.551,84
CAC40	5.387,96	2,31%	13,89%	5.672,77	4.555,99
ESTX 50 PR	3.375,38	1,98%	12,46%	3.573,57	2.908,70
XTRA DAX	11.845,41	1,68%	12,18%	12.704,58	10.279,20
S&P 500	2.923,16	1,35%	16,59%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	8.869,00	1,41%	3,85%	9.794,00	8.286,20
NIKKEI 225	20.593,35	0,37%	2,89%	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.