

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

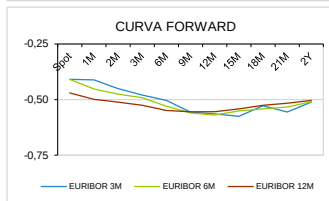
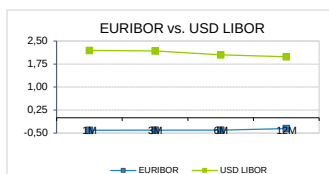
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

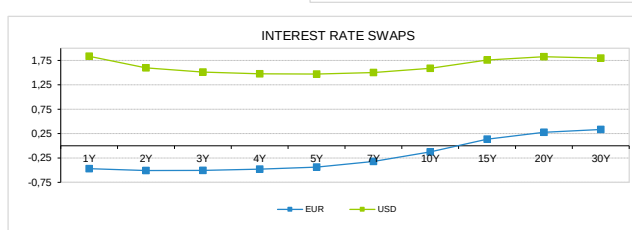
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4050	0	-1	1M	2,1943	-1	-17	0,7113	-0,8228
3M	-0,4000	0	-4	3M	2,1756	-1	-17	0,7638	-0,7884
6M	-0,4000	0	-6	6M	2,0520	0	-20	0,7956	-0,7752
12M	-0,3520	-1	-7	12M	1,9879	-1	-29	0,8271	-0,6674

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4690	0	-8	-0,5544	-0,4041	-0,1273
2Y	-0,5080	-2	-11	-0,5296	-0,3363	-0,0492
3Y	-0,5060	-2	-14	-0,4850	-0,2672	0,0290
4Y	-0,4790	-2	-17	-0,4306	-0,1941	0,1040
5Y	-0,4380	-2	-19	-0,3696	-0,1168	0,1690
7Y	-0,3220	-1	-21	-0,2328	0,0250	0,2805
10Y	-0,1270	-1	-25	-0,0361	0,1878	0,3998
15Y	0,1340	0	-29	0,1880	0,3479	0,4850
20Y	0,2760	1	-31	0,3019	0,4057	0,4898
30Y	0,3340	1	-32	0,3293	0,3842	0,4255

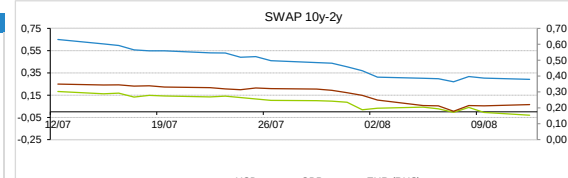
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,00
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,8350	0	-17	1,3567	1,2940	1,4830
2Y	1,5980	0	-32	1,2950	1,3360	1,5280
3Y	1,5100	-1	-34	1,3146	1,3850	1,5710
4Y	1,4750	-1	-35	1,3170	1,4330	1,6110
5Y	1,4710	-2	-36	1,3500	1,4780	1,6732
7Y	1,5030	-3	-39	1,4240	1,5590	1,7140
10Y	1,5880	-4	-41	1,5320	1,6530	1,7740
15Y	1,7590	-13	-28	1,6520	1,7390	1,8200
20Y	1,8270	-14	-29	1,7289	1,7902	1,8476
30Y	1,7970	-7	-43	1,7390	1,7740	1,8060

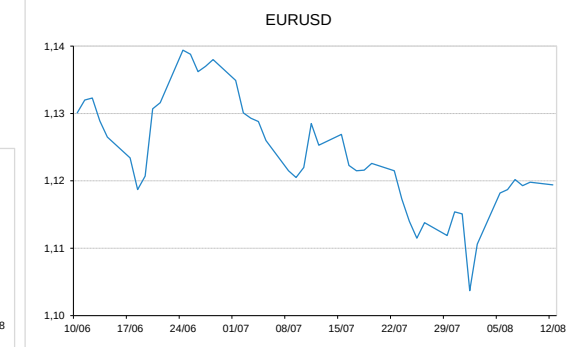
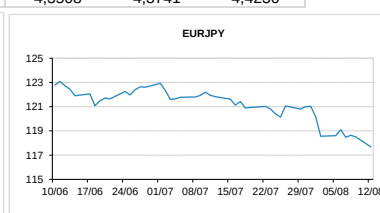


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	58,58	0,05	-7,76	OT 2Y	-0,588	-0,02	-15,00
JETFUEL	594,50	0,34	-52,42	OT 5Y	-0,254	-0,04	-15,70
DIESEL	563,25	1,59	-45,92	OT 10Y	0,241	-0,05	-32,70
COBRE	5.766,50	-43,00	-67,00	BUND 10Y	-1,233	-1,80	-37,90
ZINCO	2.230,00	-72,25	-130,00	SCHATZ 2Y	-0,242	-1,37	-13,40
OURO	1.505,46	5,41	94,07	T-NOTE 10Y	2,559	-4,88	-31,70
TRIGO	501,25	-0,25	-33,75	T-NOTE 2Y	2,023	-3,82	-20,80
LICENÇA C02	26,66	-1,46	-2,13	GILT 10Y	0,480	-0,43	-35,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1194	-0,04%	-0,52%	1,1272	1,1350	1,1481
EUR/GBP	0,92615	0,22%	-3,05%	0,9292	0,9324	0,9385
EUR/JPY	117,69	0,70%	3,52%	117,69	117,69	117,69
EUR/CHF	1,0873	0,23%	2,01%	1,0859	1,0844	1,0820
EUR/BRL	4,475	-1,31%	-5,83%	4,5397	4,5997	4,7273
EUR/PLN	4,3279	-0,08%	-1,34%	4,3508	4,3741	4,4236



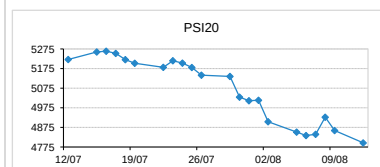
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1194	0,9262	117,69	1,0873	10,7341	7,4637	1,4845	1,66022	4,4750	9,9945
USD	0,8914	-	0,8275	105,315	0,9701	9,5682	6,6530	1,3234	1,4796	3,9903	8,9057

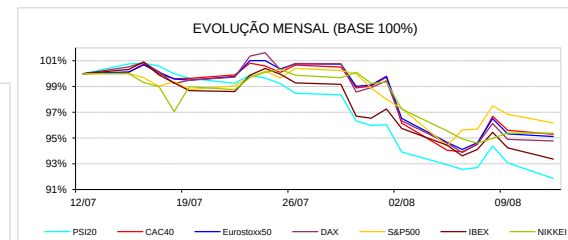
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,450	-1,00	-6,03
BCP	0,198	-5,22	-13,77
CORT. AMORIM	9,000	-0,88	0,00
CTT	1,805	-3,06	-38,73
EDP	3,373	0,15	10,63
EDP R	9,690	0,10	24,63
GALP	12,830	-1,80	-7,00
IBERSOL	8,260	-0,48	4,56
J MARTINS	14,435	-0,24	39,60
MOTA ENGIL	1,683	-1,69	4,53
NAVIGATOR	2,838	-0,77	-21,17
NOS	5,470	-0,91	3,31
NOVABASE	2,700	1,89	33,66
PHAROL	0,140	-3,58	-14,22
RAMADA	6,200	-0,32	-17,33
REN	11,460	-1,72	-12,52
SEMAPA	0,644	-1,08	-24,15
SONAE CAP.	0,797	-1,18	-1,60
SONAE SGPS	6,200	-0,32	-17,33

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOVABASE	1,89
EDP	0,15
EDP R	0,10
REN	-1,72
GALP	-1,80
CTT	-3,06
PHAROL	-3,58
BCP	-5,22



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.796,20	-1,29%	1,37%	5.630,94	4.551,84
CAC40	5.310,31	-0,33%	12,25%	5.672,77	4.555,99
ESTX 50 PR	3.326,55	-0,22%	10,83%	3.573,57	2.908,70
XTRA DAX	11.679,68	-0,12%	10,61%	12.656,05	10.279,20
S&P 500	2.898,11	-0,69%	15,63%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	8.676,40	-0,93%	1,60%	9.675,60	8.286,20
NIKKEI 225	20.684,82	0,44%	3,35%	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.