

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

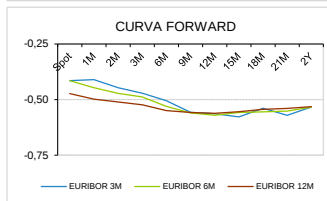
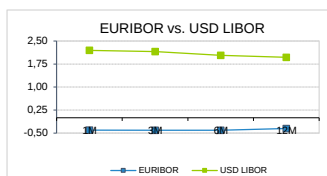
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

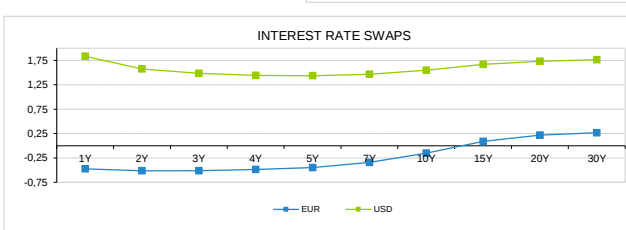
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4030	1	-1	1M	2,1951	0	-14	0,7123	-0,8180
3M	-0,4060	0	-4	3M	2,1581	-2	-16	0,7594	-0,7968
6M	-0,4060	-1	-6	6M	2,0340	-2	-20	0,7966	-0,7906
12M	-0,3500	1	-7	12M	1,9701	-2	-26	0,8234	-0,6930

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4731	1	-8	-0,5658	-0,4610	-0,2423
2Y	-0,5130	0	-12	-0,5510	-0,4104	-0,1768
3Y	-0,5110	0	-16	-0,5167	-0,3533	-0,1070
4Y	-0,4870	0	-21	-0,4778	-0,2932	-0,0375
5Y	-0,4460	0	-25	-0,4319	-0,2276	0,0182
7Y	-0,3400	-1	-32	-0,3190	-0,1007	0,1258
10Y	-0,1520	-2	-39	-0,1439	0,0519	0,2390
15Y	0,0890	-4	-47	0,0628	0,2002	0,3226
20Y	0,2190	-5	-51	0,1642	0,2551	0,3311
30Y	0,2680	-6	-53	0,1907	0,2341	0,2677

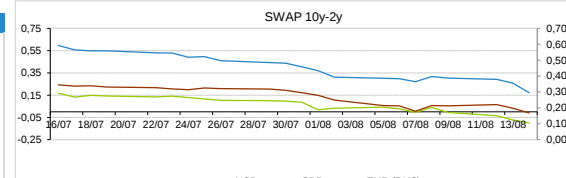
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,00
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,8350	0	-17	1,4100	1,2930	1,3975
2Y	1,5770	-2	-31	1,2865	1,3185	1,4342
3Y	1,4850	-3	-36	1,3000	1,3460	1,4520
4Y	1,4450	-3	-38	1,2990	1,3710	1,4840
5Y	1,4360	-4	-43	1,3290	1,3970	1,5364
7Y	1,4670	-4	-47	1,3710	1,4565	1,5710
10Y	1,5510	-4	-52	1,4510	1,5350	1,6396
15Y	1,6690	-9	-54	1,5450	1,6090	1,6695
20Y	1,7320	-10	-55	1,5905	1,6345	1,6745
30Y	1,7650	-3	-55	1,6130	1,6360	1,6550

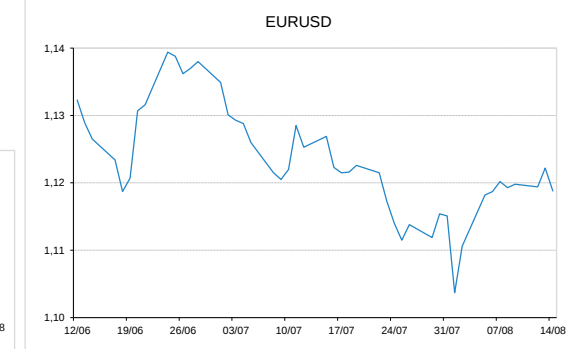
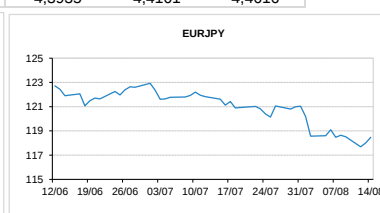


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	58,79	-2,51	-7,55	OT 2Y	-0,586	0,00	-12,60
JETFUEL	600,25	-12,65	-46,67	OT 5Y	-0,274	-0,03	-16,20
DIESEL	566,63	-14,02	-42,54	OT 10Y	0,172	-0,06	-41,40
COBRE	5.844,00	86,50	-106,50	BUND 10Y	-1,287	-4,16	-40,20
ZINCO	2.316,75	43,00	-123,00	SCHATZ 2Y	-0,238	-0,23	-12,60
OURO	1.517,29	15,04	105,90	T-NOTE 10Y	2,530	-6,39	-32,70
TRIGO	478,50	2,75	-56,50	T-NOTE 2Y	2,026	-8,03	-18,60
LICENÇA C02	26,87	-0,23	-1,92	GILT 10Y	0,442	-4,07	-34,50



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1188	-0,30%	-0,72%	1,1267	1,1344	1,1475
EUR/GBP	0,92673	0,17%	-3,02%	0,9298	0,9330	0,9392
EUR/JPY	118,48	-0,40%	2,65%	118,48	118,48	118,48
EUR/CHF	1,0851	0,49%	2,18%	1,0835	1,0817	1,0791
EUR/BRL	4,4711	-0,92%	-5,38%	4,5329	4,5935	4,7145
EUR/PLN	4,3707	-0,85%	-2,52%	4,3935	4,4161	4,4616



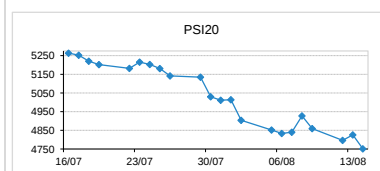
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1188	0,9267	118,48	1,0851	10,7289	7,4591	1,4841	1,65226	4,4711	10,0002
USD	0,8969	-	0,8286	105,815	0,9725	9,6293	6,6909	1,3304	1,4812	4,0128	8,9654

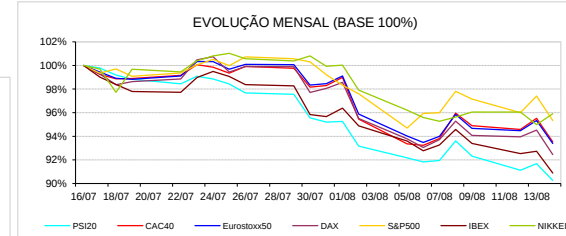
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,455	-2,59	-5,95
BCP	0,198	-4,16	-13,77
CORT. AMORIM	9,010	-0,66	0,11
CTT	1,800	-2,44	-38,90
EDP	3,321	-1,92	8,92
EDP R	9,330	-0,64	20,00
GALP	12,675	-2,24	-8,12
IBERSOL	8,160	-1,69	3,29
J MARTINS	14,305	-0,35	38,35
MOTA ENGIL	1,781	-1,98	10,62
NAVIGATOR	2,872	-1,37	-20,22
NOS	5,365	-0,74	1,32
NOVABASE	2,670	-1,42	32,18
PHAROL	0,130	-3,42	-20,34
RAMADA	6,100	-0,65	-18,67
REN	11,600	-0,68	-11,45
SEMAPA	0,622	-1,27	-26,74
SONAE CAP.	0,789	-1,50	-2,65
SONAE SGPS	6,100	-0,65	-18,67

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOVABASE	1,14
GALP	-2,24
CTT	-2,44
ALTRI	-2,59
PHAROL	-3,42
BCP	-4,16



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.750,68	-1,55%	0,41%	5.543,73	4.551,84
CAC40	5.251,30	-2,08%	11,00%	5.672,77	4.555,99
ESTX 50 PR	3.288,70	-2,04%	9,57%	3.573,57	2.908,70
XTRA DAX	11.492,66	-2,19%	8,84%	12.656,05	10.279,20
S&P 500	2.863,99	-2,13%	14,25%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	8.522,70	-1,98%	-0,20%	9.671,10	8.286,20
NIKKEI 225	20.655,13	0,98%	3,20%	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.