

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

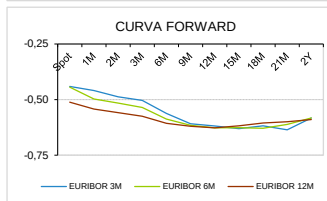
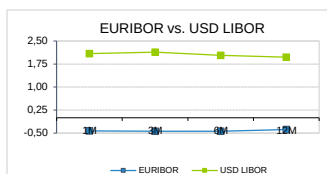
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

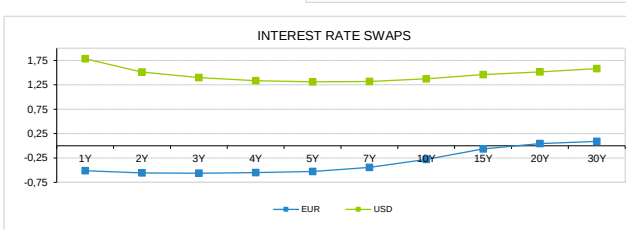
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4270	0	-4	1M	2,0890	-1	-14	0,7080	-0,8856
3M	-0,4360	0	-6	3M	2,1376	1	-12	0,7593	-0,8554
6M	-0,4390	-1	-7	6M	2,0365	1	-16	0,7824	-0,8532
12M	-0,3840	0	-8	12M	1,9740	1	-21	0,8355	-0,7590

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5114	-1	-8	-0,6306	-0,5198	-0,2985
2Y	-0,5550	-2	-12	-0,6128	-0,4711	-0,2270
3Y	-0,5630	-2	-14	-0,5818	-0,4133	-0,1525
4Y	-0,5500	-2	-17	-0,5413	-0,3480	-0,0818
5Y	-0,5260	-3	-21	-0,4921	-0,2791	-0,0200
7Y	-0,4430	-2	-26	-0,3732	-0,1481	0,0816
10Y	-0,2810	-1	-33	-0,1947	0,0035	0,1913
15Y	-0,0650	-1	-41	0,0097	0,1432	0,2647
20Y	0,0440	0	-46	0,1053	0,1946	0,2695
30Y	0,0900	0	-49	0,1340	0,1784	0,2121

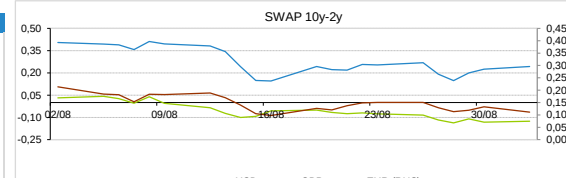
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,00
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7850	2	-30	1,2430	1,1862	1,3146
2Y	1,5110	1	-37	1,2066	1,1963	1,3535
3Y	1,4000	2	-42	1,1944	1,2363	1,3835
4Y	1,3330	-2	-48	1,2007	1,2742	1,4222
5Y	1,3110	-2	-51	1,2233	1,3073	1,4501
7Y	1,3190	-3	-57	1,2772	1,3753	1,5022
10Y	1,3740	-4	-63	1,3643	1,4534	1,5565
15Y	1,4610	-4	-67	1,4601	1,5252	1,5962
20Y	1,5140	-5	-69	1,5087	1,5541	1,6027
30Y	1,5810	4	-64	1,5333	1,5567	1,5809

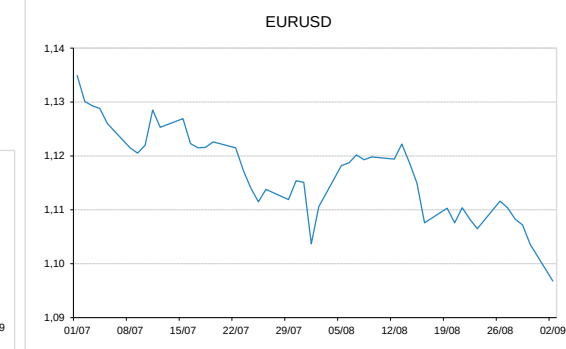
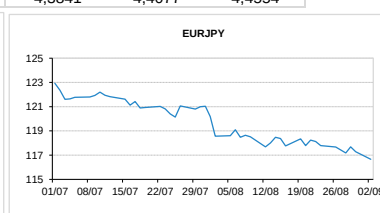


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	58,50	-0,75	-2,82	OT 2Y	-0,651	-0,01	-10,50
JETFUEL	612,25	0,75	-27,00	OT 5Y	-0,349	-0,01	-10,40
DIESEL	578,00	1,25	-18,75	OT 10Y	0,133	0,01	-21,10
COBRE	5.652,00	-74,50	-296,00	BUND 10Y	-1,328	1,11	-23,10
ZINCO	2.209,00	-64,00	-256,00	SCHATZ 2Y	-0,265	0,46	-11,90
OURO	1.528,82	5,72	81,83	T-NOTE 10Y	2,419	0,75	-23,70
TRIGO	462,50	-10,25	-40,50	T-NOTE 2Y	1,885	0,95	-14,70
LICENÇA C02	25,21	-1,11	-4,05	GILT 10Y	0,433	-5,10	-21,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0968	-0,62%	-1,24%	1,1044	1,1120	1,1251
EUR/GBP	0,9082	-0,28%	0,75%	0,9112	0,9143	0,9207
EUR/JPY	116,66	0,53%	1,64%	116,66	116,66	116,66
EUR/CHF	1,0863	0,23%	0,46%	1,0849	1,0834	1,0808
EUR/BRL	4,5693	-0,28%	-5,47%	4,6307	4,6918	4,8254
EUR/PLN	4,3608	0,41%	-1,24%	4,3841	4,4077	4,4554



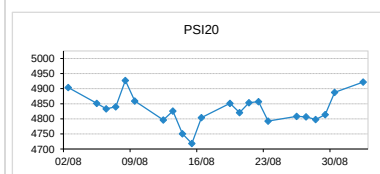
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0968	0,9082	116,66	1,0863	10,7786	7,4562	1,4612	1,63302	4,5693	9,9881
USD	0,9118	-	0,8292	106,275	0,9912	9,8176	6,7986	1,3317	1,4869	4,1601	9,1024

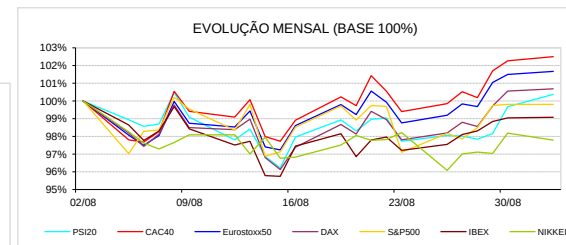
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,725	-0,43	-1,29
BCP	0,192	-0,52	-16,25
CORT. AMORIM	9,150	0,00	1,67
CTT	1,890	0,53	-35,85
EDP	3,466	0,81	13,68
EDP R	9,970	-0,50	28,23
GALP	13,005	-0,42	-5,73
IBERSOL	8,200	0,49	3,80
J MARTINS	15,640	4,20	51,26
MOTA ENGIL	1,903	0,48	18,20
NAVIGATOR	3,062	-0,33	-14,94
NOS	5,365	0,37	1,32
NOVABASE	2,870	-1,37	42,08
PHAROL	0,116	6,42	-28,92
RAMADA	6,340	0,00	-15,47
REN	12,060	0,00	-7,94
SEMAPA	0,620	0,00	-26,97
SONAE CAP.	0,835	1,21	3,09
SONAE SGPS	6,340	0,00	-15,47

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	6,42
J MARTINS	4,20
SONAE CAP.	1,21
EDP	0,81
CTT	0,53
GALP	-0,42
ALTRI	-0,43
EDP R	-0,50
BCP	-0,52
NOVABASE	-1,37



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.921,90	0,70%	4,02%	5.461,86	4.551,84
CAC40	5.493,04	0,23%	16,11%	5.672,77	4.555,99
ESTX 50 PR	3.432,54	0,17%	14,36%	3.573,57	2.908,70
XTRA DAX	11.953,78	0,12%	13,21%	12.656,05	10.279,20
S&P 500	2.926,46	0,06%	16,74%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	8.815,50	0,03%	3,23%	9.665,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.620,19	-0,41%	3,02%	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.