

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

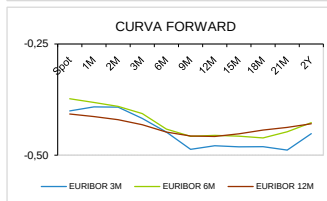
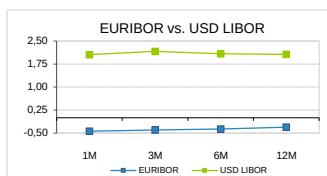
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

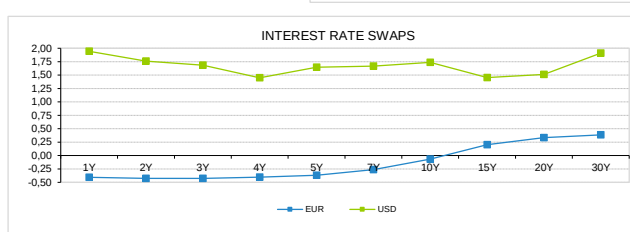
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4380	1	-2	1M	2,0570	2	-12	0,7141	-0,8664
3M	-0,3960	0	2	3M	2,1641	2	3	0,7828	-0,8108
6M	-0,3690	0	6	6M	2,0853	1	7	0,8455	-0,7536
12M	-0,3060	0	8	12M	2,0654	0	12	0,9495	-0,6120

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4074	0	9	-0,4590	-0,3603	-0,1330
2Y	-0,4260	1	13	-0,4456	-0,3050	-0,0595
3Y	-0,4250	0	14	-0,4155	-0,2473	0,0231
4Y	-0,4030	-1	15	-0,3729	-0,1819	0,1007
5Y	-0,3690	-2	17	-0,3257	-0,1078	0,1798
7Y	-0,2640	-3	20	-0,2034	0,0351	0,2898
10Y	-0,0680	-3	25	-0,0089	0,2075	0,4164
15Y	0,2020	-4	31	0,2195	0,3667	0,4978
20Y	0,3350	-4	33	0,3208	0,4141	0,4923
30Y	0,3850	-3	34	0,3371	0,3838	0,4202

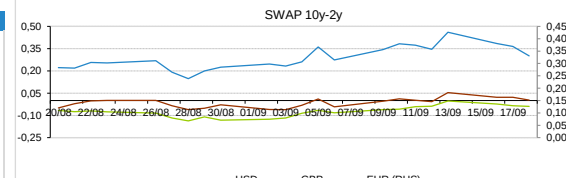
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,00
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,9430	-1	17	1,4700	1,4420	1,5815
2Y	1,7600	-2	23	1,4330	1,5023	1,6070
3Y	1,6840	-2	24	1,4370	1,5100	1,6395
4Y	1,4490	7	-3	1,4600	1,5425	1,6770
5Y	1,6450	-2	24	1,4815	1,5755	1,7318
7Y	1,6670	13	25	1,5345	1,6410	1,7545
10Y	1,7370	-2	27	1,6215	1,7100	1,7990
15Y	1,4540	-1	-44	1,7075	1,7775	1,8410
20Y	1,5110	0	-45	1,7555	1,8060	1,8465
30Y	1,9080	-2	28	1,7740	1,7980	1,8210

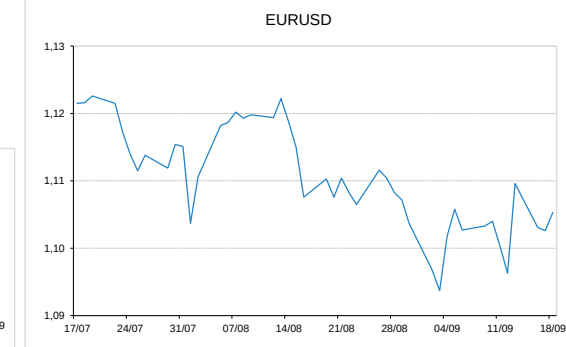
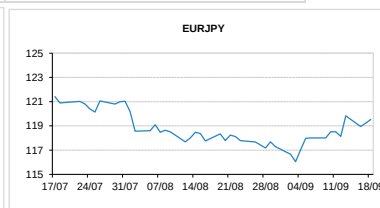
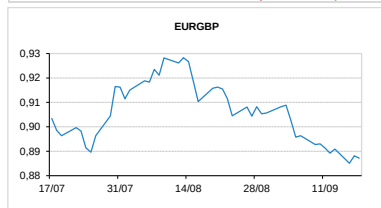


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	63,91	-0,64	5,75	OT 2Y	-0,525	-0,01	5,80
JETFUEL	611,00	-1,25	11,75	OT 5Y	-0,244	-0,07	3,20
DIESEL	620,92	42,92	55,67	OT 10Y	0,243	-0,07	8,40
COBRE	5.815,50	-49,00	77,00	BUND 10Y	-0,958	-3,55	13,00
ZINCO	2.352,50	-13,00	92,00	SCHATZ 2Y	-0,108	-1,37	19,10
OURO	1.509,47	3,62	-3,56	T-NOTE 10Y	2,605	-4,28	13,00
TRIGO	490,25	6,00	12,75	T-NOTE 2Y	2,065	-4,97	18,40
LICENÇA C02	25,51	-0,71	-0,45	GILT 10Y	0,641	-4,41	8,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1053	0,24%	-0,45%	1,1126	1,1200	1,1331
EUR/GBP	0,8872	0,10%	3,23%	0,8900	0,8932	0,8994
EUR/JPY	119,54	-0,26%	-1,00%	119,54	119,54	119,54
EUR/CHF	1,1004	-0,18%	-1,17%	1,0993	1,0978	1,0956
EUR/BRL	4,5349	-0,49%	-0,48%	4,5889	4,6433	4,7627
EUR/PLN	4,3429	-0,04%	0,54%	4,3647	4,3870	4,4350



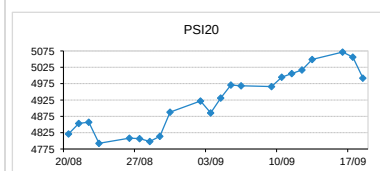
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1053	0,8872	119,54	1,1004	10,7243	7,4676	1,4692	1,61687	4,5349	9,8788
USD	0,9042	-	0,801	108,225	0,9957	9,7005	6,7520	1,3264	1,4617	4,1006	8,9270

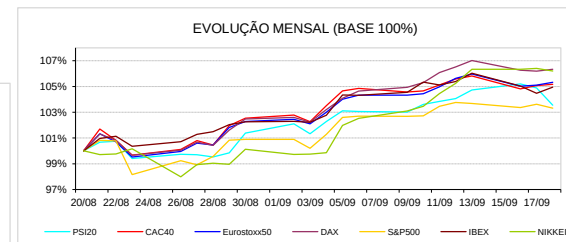
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,130	-0,49	5,69
BCP	0,200	-2,68	-12,85
CORT. AMORIM	9,910	0,00	10,11
CTT	2,158	-1,55	-26,75
EDP	3,495	0,46	14,63
EDP R	9,840	-0,81	26,56
GALP	13,705	0,55	-0,65
IBERSOL	8,080	0,00	2,28
J MARTINS	15,690	-2,64	51,74
MOTA ENGIL	2,002	-3,29	24,35
NAVIGATOR	3,202	-2,02	-11,06
NOS	5,060	-1,17	-4,44
NOVABASE	2,810	0,00	39,11
PHAROL	0,114	-3,57	-30,39
RAMADA	6,100	-0,33	-18,67
REN	12,300	-1,13	-6,11
SEMAPA	0,631	0,16	-25,68
SONAE CAP.	0,845	-3,48	4,32
SONAE SGPS	6,100	-0,33	-18,67

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
GALP	0,55
EDP	0,46
SEMAPA	0,16
J MARTINS	-2,64
BCP	-2,68
MOTA ENGIL	-3,29
SONAE CAP.	-3,48
PHAROL	-3,57



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.991,75	-1,28%	5,50%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.620,65	0,09%	18,81%	5.672,77	4.555,99
ESTX 50 PR	3.528,53	0,21%	17,56%	3.573,57	2.908,70
XTRA DAX	12.389,62	0,14%	17,34%	12.656,05	10.279,20
S&P 500	2.996,85	-0,30%	19,54%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	9.045,10	0,45%	5,92%	9.665,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.960,71	-0,18%	9,72%	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.