

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

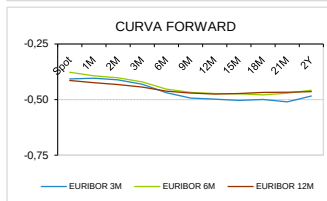
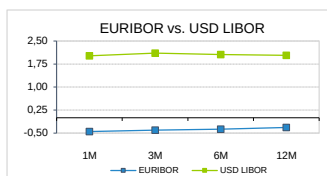
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

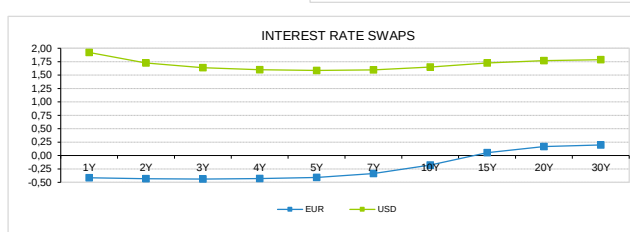
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4490	0	-4	1M	2,0184	-2	-12	0,7134	-0,8088
3M	-0,4030	0	1	3M	2,1063	-3	-4	0,7650	-0,7594
6M	-0,3730	-1	4	6M	2,0585	-1	-2	0,8403	-0,7074
12M	-0,3160	-1	4	12M	2,0334	-3	0	0,9434	-0,5852

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4141	-1	6	-0,4751	-0,4224	-0,2509
2Y	-0,4320	-1	7	-0,4698	-0,3804	-0,1889
3Y	-0,4390	-1	6	-0,4520	-0,3350	-0,1172
4Y	-0,4280	-2	5	-0,4262	-0,2845	-0,0490
5Y	-0,4080	-3	4	-0,3891	-0,2218	0,0110
7Y	-0,3370	-5	1	-0,2928	-0,1000	0,1104
10Y	-0,1770	-6	0	-0,1304	0,0455	0,2224
15Y	0,0520	-8	-1	0,0634	0,1817	0,2914
20Y	0,1670	-9	-2	0,1483	0,2230	0,2877
30Y	0,1970	-10	-5	0,1573	0,1900	0,2152

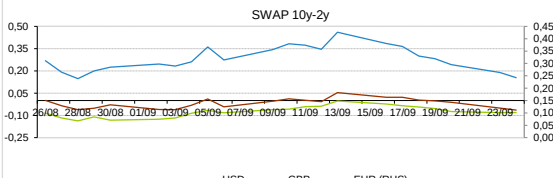
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,50
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,9210	3	14	1,4570	1,3350	1,4590
2Y	1,7250	1	21	1,3536	1,3690	1,4830
3Y	1,6380	0	21	1,3400	1,4010	1,5110
4Y	1,6000	-1	21	1,3560	1,4260	1,5420
5Y	1,5860	-1	21	1,3770	1,4585	1,5995
7Y	1,5960	-7	20	1,4250	1,5215	1,6300
10Y	1,6500	-2	19	1,5020	1,5870	1,6730
15Y	1,7240	27	17	1,5890	1,6525	1,7135
20Y	1,7700	26	16	1,6350	1,6810	1,7190
30Y	1,7870	-2	14	1,6779	1,6770	1,6955

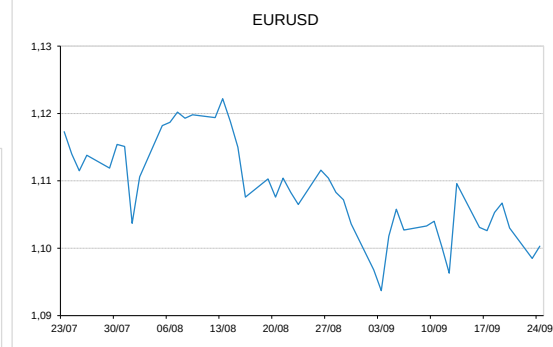
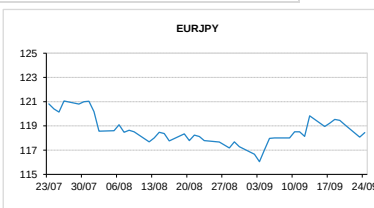


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	63,70	-1,07	4,90	OT 2Y	-0,562	-0,02	1,70
JETFUEL	612,25	0,00	15,50	OT 5Y	-0,297	-0,03	-1,00
DIESEL	578,00	0,00	19,00	OT 10Y	0,143	-0,03	-2,10
COBRE	5.793,50	-20,00	145,00	BUND 10Y	-1,043	-0,68	7,20
ZINCO	2.343,00	30,00	85,00	SCHATZ 2Y	-0,119	-0,23	17,30
OURO	1.527,54	4,51	0,56	T-NOTE 10Y	2,535	-3,50	11,30
TRIGO	480,50	-2,50	2,75	T-NOTE 2Y	2,015	-4,58	14,30
LICENÇA C02	25,55	-0,25	0,45	GILT 10Y	0,526	-0,70	-4,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1003	0,16%	-1,02%	1,1078	1,1151	1,1281
EUR/GBP	0,88153	0,22%	3,01%	0,8844	0,8876	0,8940
EUR/JPY	118,45	-0,32%	-0,66%	118,45	118,45	118,45
EUR/CHF	1,0853	0,20%	0,29%	1,0843	1,0832	1,0815
EUR/BRL	4,5911	-0,23%	0,51%	4,6459	4,7012	4,8155
EUR/PLN	4,3798	0,26%	-0,47%	4,4032	4,4269	4,4758



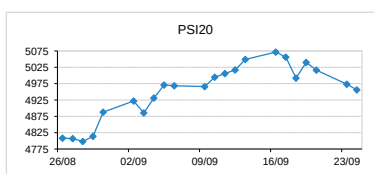
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1003	0,8815	118,45	1,0853	10,6582	7,4655	1,4578	1,6191	4,5911	9,8990
USD	0,9093	-	0,8015	107,415	0,9879	9,6878	6,7886	1,3261	1,4720	4,1726	9,0032

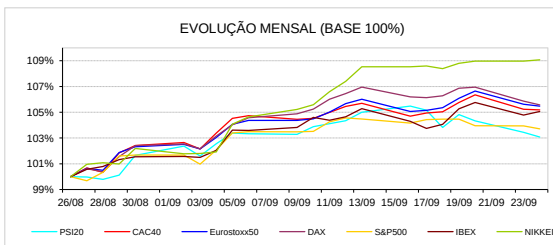
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,040	-0,25	4,14
BCP	0,187	-1,32	-18,34
CORT. AMORIM	10,080	0,60	12,00
CTT	2,012	-6,68	-31,70
EDP	3,547	1,05	16,33
EDP R	9,870	-0,10	26,95
GALP	13,675	-0,55	-0,87
IBERSOL	8,060	-0,25	2,03
J MARTINS	15,775	-0,03	52,56
MOTA ENGIL	1,898	-2,77	17,89
NAVIGATOR	3,182	-1,30	-11,61
NOS	5,060	-0,59	-4,44
NOVABASE	2,830	-0,70	40,10
PHAROL	0,106	-3,27	-34,80
RAMADA	6,020	0,33	-19,73
REN	11,900	-0,17	-9,16
SEMAPA	0,602	0,33	-29,09
SONAE CAP.	0,841	0,30	3,77
SONAE SGPS	6,020	0,33	-19,73

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP	1,05
CORT. AMORIM	0,60
RAMADA	0,33
RAMADA	0,33
NAVIGATOR	-1,30
BCP	-1,32
MOTA ENGIL	-2,77
PHAROL	-3,27
CTT	-6,68



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.955,87	-0,35%	4,74%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.628,33	-0,04%	18,97%	5.696,25	4.555,99
ESTX 50 PR	3.532,05	-0,14%	17,68%	3.578,04	2.908,70
XTRA DAX	12.307,15	-0,29%	16,56%	12.656,05	10.279,20
S&P 500	2.985,16	-0,22%	19,08%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	9.118,20	0,27%	6,77%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	22.098,84	0,09%	10,41%	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.