

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

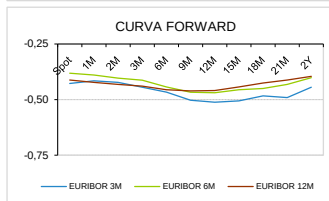
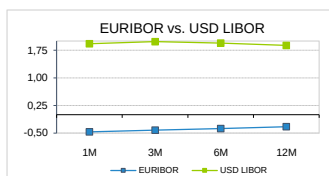
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

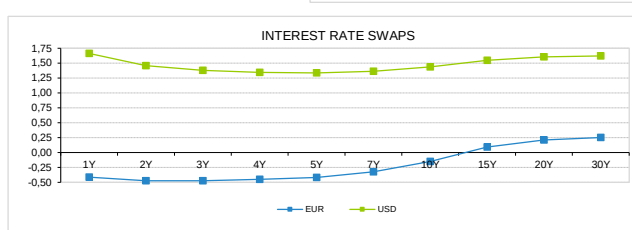
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4660	0	-1	1M	1,9274	-1	-12	0,7094	-0,8030
3M	-0,4180	0	2	3M	1,9843	-3	-15	0,7643	-0,7900
6M	-0,3750	1	4	6M	1,9428	-2	-9	0,8161	-0,7344
12M	-0,3260	1	4	12M	1,8819	-1	-7	0,8691	-0,6274

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4125	2	6	-0,4590	-0,3023	-0,0630
2Y	-0,4730	1	4	-0,4288	-0,2455	0,0035
3Y	-0,4730	1	5	-0,3862	-0,1848	0,0765
4Y	-0,4490	1	5	-0,3370	-0,1210	0,1465
5Y	-0,4170	1	5	-0,2817	-0,0524	0,2175
7Y	-0,3230	1	4	-0,1589	0,0805	0,3140
10Y	-0,1490	1	3	0,0251	0,2348	0,4290
15Y	0,0920	1	1	0,2359	0,3784	0,5043
20Y	0,2120	1	1	0,3329	0,4250	0,4979
30Y	0,2520	1	-1	0,3457	0,3899	0,4202

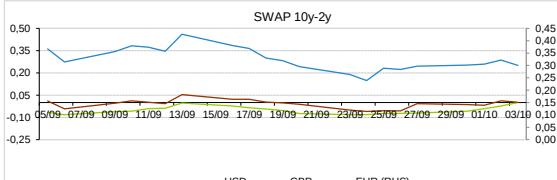
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,6630	1	-13	1,3805	1,3385	1,5200
2Y	1,4570	-1	-7	1,2915	1,3980	1,5105
3Y	1,3790	-1	-4	1,3035	1,3665	1,5755
4Y	1,3450	-1	-3	1,2800	1,4095	1,6420
5Y	1,3360	-1	-3	1,3270	1,4520	1,6980
7Y	1,3620	-1	-2	1,3975	1,5280	1,7035
10Y	1,4360	-1	-1	1,5700	1,6090	1,7395
15Y	1,5480	-8	9	1,5915	1,7215	1,7470
20Y	1,6040	-7	9	1,6965	1,7010	1,7985
30Y	1,6210	-1	0	1,6725	1,7275	1,7795

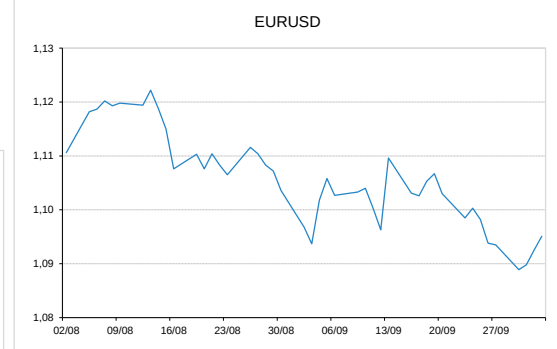
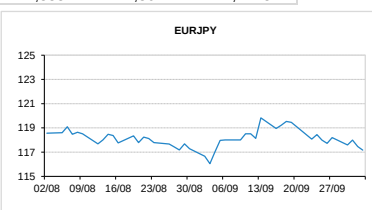
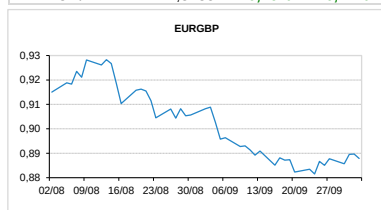


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	58,70	0,38	-2,74	OT 2Y	-0,590	0,02	5,50
JETFUEL	624,57	10,46	-5,60	OT 5Y	-0,229	0,04	3,50
DIESEL	592,57	11,71	-5,60	OT 10Y	0,193	0,06	-2,00
COBRE	5.688,00	8,50	-131,00	BUND 10Y	-0,929	7,42	8,30
ZINCO	2.328,00	8,00	13,50	SCHATZ 2Y	-0,098	4,34	12,10
OURO	1.494,61	-10,17	3,28	T-NOTE 10Y	2,506	5,28	4,30
TRIGO	500,00	-0,25	17,75	T-NOTE 2Y	1,958	4,95	4,10
LICENÇA C02	23,22	0,57	-3,50	GILT 10Y	0,560	10,52	-7,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,103	0,45%	-0,09%	1,1105	1,1168	1,1290
EUR/GBP	0,90155	-0,34%	-0,95%	0,9045	0,9074	0,9134
EUR/JPY	118,52	-0,51%	0,00%	118,52	118,52	118,52
EUR/CHF	1,0969	-0,36%	-0,19%	1,0957	1,0947	1,0929
EUR/BRL	4,523	-0,32%	-0,33%	4,5721	4,6144	4,7239
EUR/PLN	4,3135	0,16%	0,42%	4,3384	4,3621	4,4123



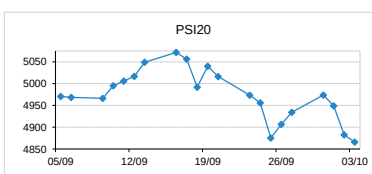
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1030	0,9016	118,52	1,0969	10,8424	7,4682	1,4619	1,62751	4,5230	10,0461
USD	0,9080	-	0,814	107,955	0,9960	9,8418	6,7807	1,3286	1,4801	4,1007	9,1266

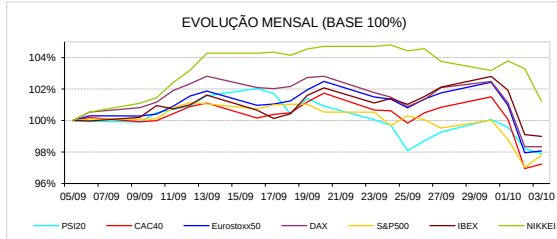
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,315	3,61	-8,36
BCP	0,192	0,79	-16,56
CORT. AMORIM	9,700	0,73	7,78
CTT	2,178	0,00	-26,07
EDP	3,590	-0,64	17,74
EDP R	9,720	2,21	25,02
GALP	13,480	0,00	-2,28
IBERSOL	7,960	-0,75	0,76
J MARTINS	15,055	0,03	45,60
MOTA ENGIL	1,824	1,73	13,29
NAVIGATOR	3,144	2,01	-12,67
NOS	5,175	0,39	-2,27
NOVABASE	2,560	5,79	26,73
PHAROL	0,104	0,39	-36,40
RAMADA	6,060	-0,33	-19,20
REN	11,880	3,66	-9,31
SEMAPA	0,613	-0,16	-27,80
SONAE CAP.	0,890	-0,06	9,88
SONAE SGPS	6,060	-0,33	-19,20

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOVABASE	5,79
REN	3,66
ALTRI	3,61
EDP R	2,21
NAVIGATOR	2,01
SEMAPA	-0,16
RAMADA	-0,33
RAMADA	-0,33
EDP	-0,64
IBERSOL	-0,75



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.946,35	0,51%	4,54%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.572,53	1,33%	17,80%	5.704,93	4.555,99
ESTX 50 PR	3.496,67	1,00%	16,50%	3.588,68	2.908,70
XTRA DAX	12.184,07	0,74%	15,39%	12.656,05	10.279,20
S&P 500	2.946,01	0,92%	17,53%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	9.103,40	1,24%	6,60%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	21.551,98	0,45%	7,68%	23.589,38	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.