

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

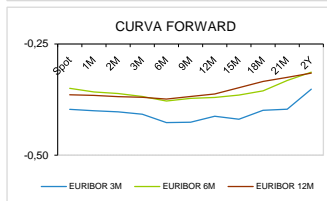
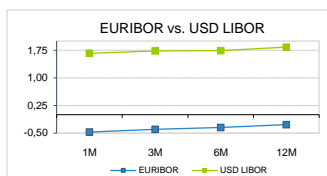
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

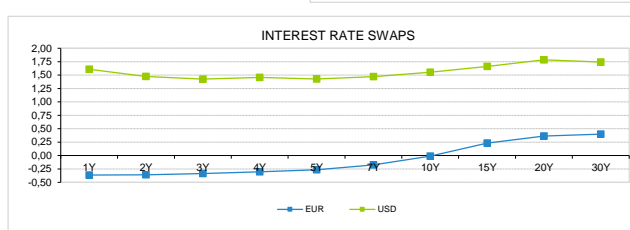
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4710	-1	-1	1M	1,6653	-1	-3	0,7033	-0,7628
3M	-0,3970	0	0	3M	1,7309	0	-15	0,7524	-0,6886
6M	-0,3460	-1	-1	6M	1,7404	-1	-14	0,8116	-0,6326
12M	-0,2690	0	-2	12M	1,8349	-1	-12	0,8771	-0,4836

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3640	-1	-3	-0,3640	-0,2382	-0,0542
2Y	-0,3580	-1	-4	-0,3391	-0,1976	0,0042
3Y	-0,3360	-1	-6	-0,3055	-0,1492	0,0690
4Y	-0,3040	-2	-7	-0,2680	-0,0957	0,1319
5Y	-0,2660	-2	-8	-0,2251	-0,0372	0,1780
7Y	-0,1740	-3	-11	-0,1232	0,0800	0,3026
10Y	-0,0110	-4	-13	0,0422	0,2450	0,4270
15Y	0,2310	-4	-14	0,2605	0,4026	0,5230
20Y	0,3620	-4	-14	0,3646	0,4534	0,5240
30Y	0,3990	-4	-14	0,3732	0,4117	0,4393

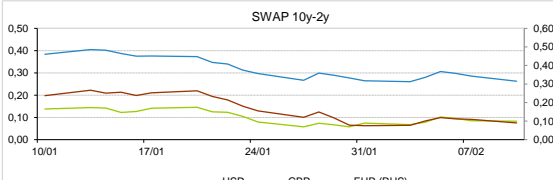
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,75
Índia	4,00



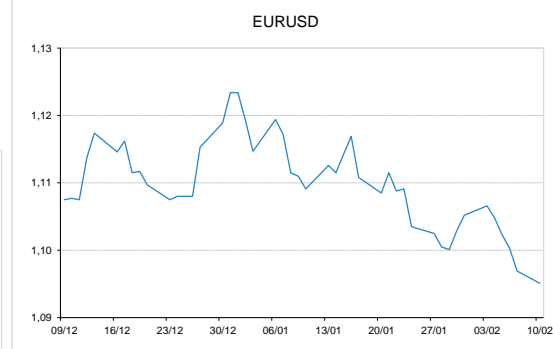
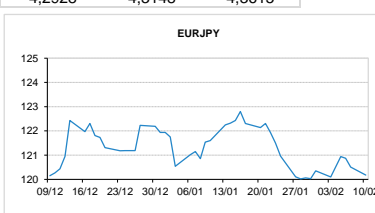
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,6080	-3	-11	1,2882	1,3020	1,4740
2Y	1,4730	-4	-14	1,2540	1,3455	1,5110
3Y	1,4250	-5	-16	1,2720	1,3890	1,5470
4Y	1,4570	3	-19	1,2990	1,4290	1,5977
5Y	1,4280	-5	-17	1,3330	1,4660	1,6329
7Y	1,4710	-6	-18	1,4179	1,5390	1,6730
10Y	1,5530	-6	-20	1,5030	1,6361	1,7220
15Y	1,6610	-6	-20	1,6242	1,6940	1,7815
20Y	1,7840	6	-12	1,6784	1,7210	1,7670
30Y	1,7430	-6	-20	1,6800	1,7070	1,7250



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	53,44	-1,03	-10,81	OT 2Y	-0,402	-0,02	7,60
JETFUEL	518,59	-9,64	-115,19	OT 5Y	-0,111	-0,02	-1,70
DIESEL	497,87	-9,59	-100,38	OT 10Y	0,294	-0,02	-11,10
COBRE	5.655,00	-72,00	-486,00	BUND 10Y	-1,042	-3,04	-23,60
ZINCO	2.142,50	-69,75	-212,50	SCHATZ 2Y	-0,009	0,00	-4,60
OURO	1.576,77	6,33	14,43	T-NOTE 10Y	2,450	-2,26	-23,60
TRIGO	555,25	-3,50	-9,25	T-NOTE 2Y	1,868	-2,28	-16,80
LICENÇA C02	23,16	-0,16	-1,05	GILT 10Y	0,464	-1,82	-29,00


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0951	-0,16%	-1,26%	1,1011	1,1068	1,1180
EUR/GBP	0,84628	0,11%	0,22%	0,8489	0,8514	0,8564
EUR/JPY	120,18	0,27%	1,18%	120,18	120,18	120,18
EUR/CHF	1,0665	0,33%	1,41%	1,0658	1,0650	1,0632
EUR/BRL	4,7165	0,21%	-3,35%	4,7589	4,8013	4,9107
EUR/PLN	4,2717	0,04%	-0,81%	4,2928	4,3148	4,3615

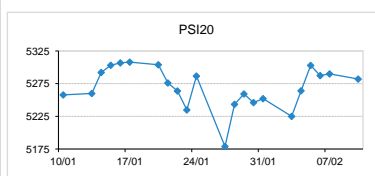

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0951	0,8463	120,18	1,0665	10,5509	7,4724	1,4546	1,63504	4,7165	10,1478
USD	0,9155	-	0,7738	109,725	0,9772	9,6643	6,8412	1,3321	1,4972	4,3137	9,2794

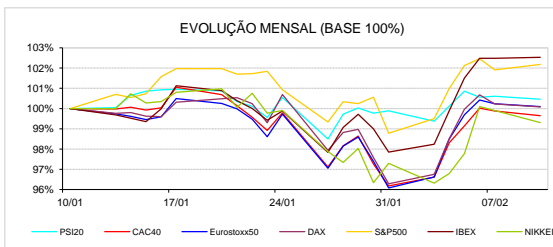
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	5,735	0,88	0,97
BCP	0,188	-3,49	-7,30
CORT. AMORIM	10,540	0,76	-6,73
CTT	2,892	-1,50	-9,34
EDP	4,646	1,31	20,24
EDP R	12,320	0,16	17,33
GALP	13,560	-1,42	-8,99
IBERSOL	9,000	4,65	12,50
J MARTINS	16,230	2,04	10,67
MOTA ENGIL	1,672	-0,18	-10,59
NAVIGATOR	3,304	0,85	-4,19
NOS	4,442	-2,80	-7,46
PHAROL	0,100	-0,30	0,10
RAMADA	5,680	1,07	-2,74
REN	2,720	-0,37	0,00
SEMAPA	12,480	-0,16	-9,04
SONAE CAP.	0,764	0,39	1,46
SONAE SGPS	0,833	0,42	-8,46

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	4,65
J MARTINS	2,04
EDP	1,31
RAMADA	1,07
ALTRI	0,88
REN	-0,37
GALP	-1,42
CTT	-1,50
NOS	-2,80
BCP	-3,49



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.282,06	-0,15%	1,30%	5.429,32	4.699,20
CAC40	6.015,67	-0,23%	0,63%	6.109,81	4.946,14
ESTX 50 PR	3.793,18	-0,14%	1,28%	3.813,80	3.124,62
XTRA DAX	13.494,03	-0,15%	1,85%	13.640,06	10.863,56
S&P 500	3.336,24	0,26%	3,27%	3.347,96	2.681,83
IBEX 35	9.816,00	0,05%	2,79%	9.820,40	8.409,20
NIKKEI 225	23.685,98	-0,60%	0,12%	24.115,95	20.110,76



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.