

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

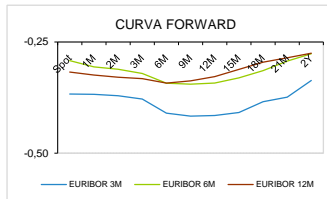
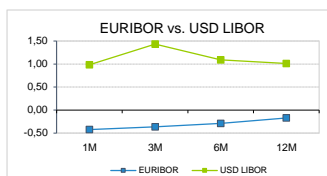
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

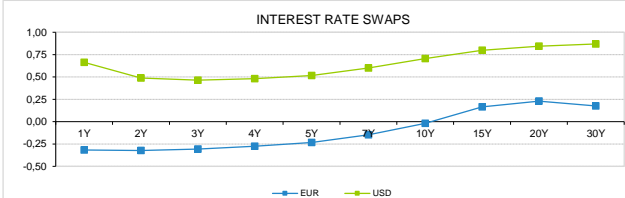
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4230	1	7	1M	0,9845	0	-53	0,2524	-0,7998
3M	-0,3630	-1	6	3M	1,4334	-2	-3	0,5703	-0,6640
6M	-0,2870	-1	10	6M	1,0918	2	-31	0,7286	-0,5804
12M	-0,1710	-1	14	12M	1,0140	5	-37	0,8615	-0,4562

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3173	1	13	-0,3310	-0,1790	0,0002
2Y	-0,3229	0	15	-0,3072	-0,1250	0,0601
3Y	-0,3070	1	15	-0,2653	-0,0798	0,1043
4Y	-0,2750	1	16	-0,2147	-0,0314	0,1486
5Y	-0,2333	1	17	-0,1714	0,0116	0,2036
7Y	-0,1476	2	19	-0,0797	0,0998	0,2699
10Y	-0,0188	2	18	0,0535	0,2200	0,3587
15Y	0,1644	3	17	0,2106	0,3091	0,3795
20Y	0,2293	3	13	0,2475	0,2946	0,3182
30Y	0,1762	3	7	0,1734	0,1883	0,1904

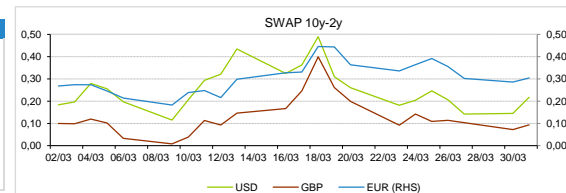
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,75
Austrália	0,25
Índia	3,00



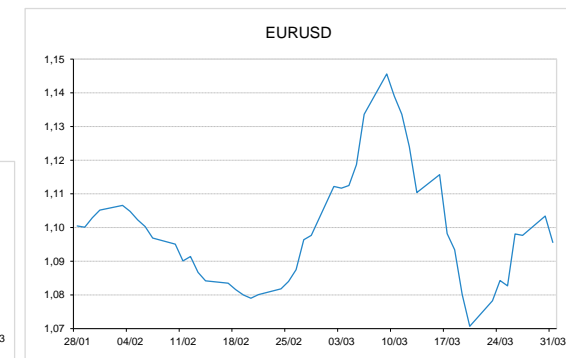
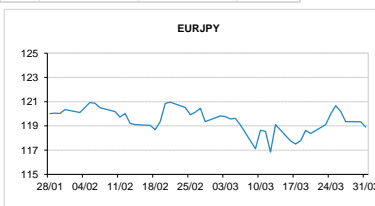
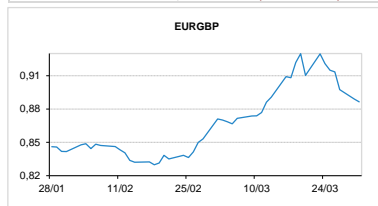
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,6636	-3	-33	0,3493	0,4990	0,7565
2Y	0,4879	-1	-40	0,3788	0,5850	0,8085
3Y	0,4640	1	-42	0,4070	0,6380	0,8380
4Y	0,4809	2	-42	0,4685	0,6930	0,8727
5Y	0,5160	3	-41	0,5280	0,7360	0,9027
7Y	0,6003	4	-38	0,6290	0,8010	0,9170
10Y	0,7055	7	-37	0,7310	0,8560	0,9340
15Y	0,7991	9	-39	0,8090	0,8950	0,9470
20Y	0,8442	10	-40	0,8468	0,9020	0,9380
30Y	0,8690	12	-40	0,8636	0,8885	0,8945



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	22,74	-0,02	-26,93	OT 2Y	-0,058	0,05	29,60
JETFUEL	254,25	0,00	-217,00	OT 5Y	0,399	0,11	42,30
DIESEL	292,13	-14,34	-162,37	OT 10Y	0,869	0,13	51,60
COBRE	4.756,50	-21,00	-865,50	BUND 10Y	-0,896	7,58	15,00
ZINCO	1.865,75	-6,25	-152,25	SCHATZ 2Y	-0,078	3,20	8,70
OURO	1.609,59	-11,32	23,90	T-NOTE 10Y	1,753	0,28	-37,10
TRIGO	571,00	1,50	46,00	T-NOTE 2Y	0,839	-0,37	-50,20
LICENÇA C02	17,58	0,52	-6,03	GILT 10Y	0,311	3,40	-7,70


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0956	-0,71%	-1,49%	1,0994	1,1023	1,1086
EUR/GBP	0,88643	0,29%	-1,73%	0,8882	0,8902	0,8947
EUR/JPY	118,9	0,37%	0,77%	118,90	118,90	118,90
EUR/CHF	1,0609	-0,27%	0,79%	1,0601	1,0593	1,0583
EUR/BRL	5,7178	0,34%	-12,88%	5,7619	5,8052	5,9108
EUR/PLN	4,5516	-0,12%	-4,88%	4,5692	4,5786	4,5984

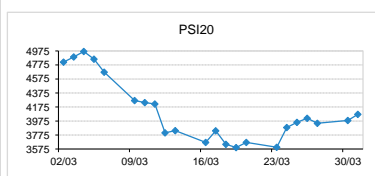

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0956	0,8864	118,90	1,0609	10,9330	7,4627	1,5567	1,79542	5,7178	11,4784
USD	0,9114	-	0,8062	107,95	0,9672	9,9172	6,8015	1,4245	1,6353	5,1857	10,5108

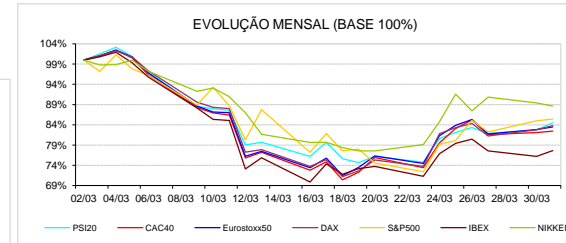
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	3,622	2,61	-36,23
BCP	0,103	-2,57	-49,46
CORT. AMORIM	8,270	0,85	-26,81
CTT	2,284	0,09	-28,40
EDP	3,658	3,22	-5,33
EDP R	10,980	5,37	4,57
GALP	10,395	4,16	-30,23
IBERSOL	4,760	-3,05	-40,50
J MARTINS	16,440	2,75	12,10
MOTA ENGIL	1,100	2,52	-41,18
NAVIGATOR	2,158	3,45	-37,42
NOS	3,052	0,33	-36,42
PHAROL	0,068	-0,87	-31,53
RAMADA	2,890	1,40	-50,51
REN	2,320	1,75	-14,71
SEMAPA	7,750	2,11	-43,51
SONAE CAP.	0,401	2,56	-46,75
SONAE SGPS	0,590	2,25	-35,22
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP R	5,37
GALP	4,16
NAVIGATOR	3,45
EDP	3,22
J MARTINS	2,75
PHAROL	-0,87
BCP	-2,57
IBERSOL	-3,05



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.069,55	2,17%	-21,95%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.396,12	0,40%	-26,46%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.786,90	0,77%	-25,59%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	9.935,84	1,22%	-25,01%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.639,79	0,49%	-18,30%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.785,40	1,88%	-28,94%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	18.917,01	-0,88%	-20,04%	24.115,95	16.358,19



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.