

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

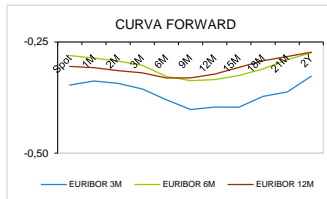
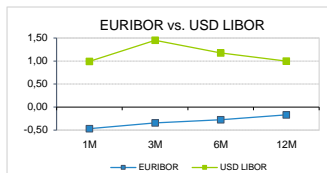
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

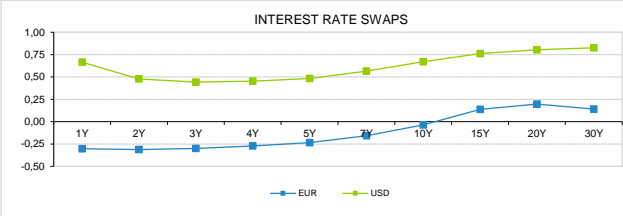
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4680	-5	2	1M	0,9929	1	-52	0,2446	-0,7804
3M	-0,3430	2	8	3M	1,4505	2	-1	0,5955	-0,6554
6M	-0,2760	1	11	6M	1,1753	8	-22	0,7251	-0,5714
12M	-0,1680	0	14	12M	0,9975	-2	-38	0,8641	-0,4524

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3040	1	15	-0,3277	-0,1860	-0,0200
2Y	-0,3125	1	16	-0,3044	-0,1380	0,0235
3Y	-0,3002	1	16	-0,2639	-0,0994	0,0670
4Y	-0,2717	0	16	-0,2184	-0,0581	0,1113
5Y	-0,2345	0	17	-0,1806	-0,0155	0,1570
7Y	-0,1584	-1	18	-0,0972	0,0697	0,2338
10Y	-0,0373	-2	17	0,0297	0,1860	0,3169
15Y	0,1370	-3	14	0,1801	0,2716	0,3351
20Y	0,1969	-3	9	0,2141	0,2580	0,2812
30Y	0,1405	-3	3	0,1388	0,1514	0,1529

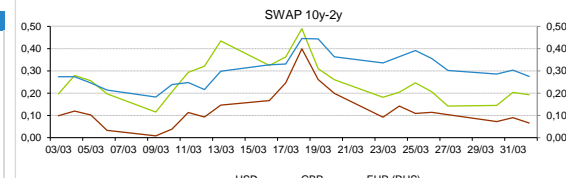
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,75
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,6654	1	-33	0,3326	0,4874	0,6985
2Y	0,4781	0	-41	0,3320	0,5305	0,7610
3Y	0,4425	-1	-44	0,3840	0,5943	0,8060
4Y	0,4535	-1	-45	0,4245	0,6460	0,8362
5Y	0,4822	-1	-44	0,4926	0,6940	0,8675
7Y	0,5655	-1	-42	0,5850	0,7605	0,8668
10Y	0,6710	-1	-40	0,6895	0,8100	0,8954
15Y	0,7607	-2	-42	0,7600	0,8517	0,9075
20Y	0,8043	-2	-44	0,8050	0,8590	0,8960
30Y	0,8262	-2	-44	0,8150	0,8255	0,8165

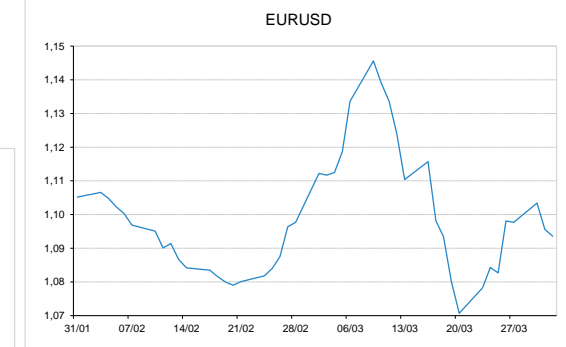
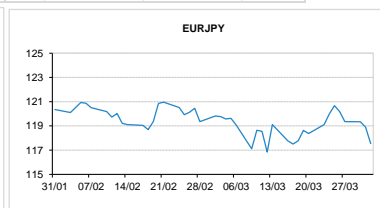
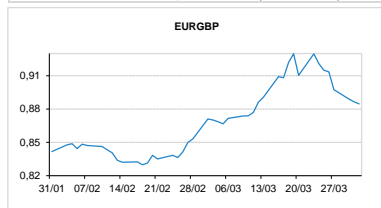


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	25,04	-1,31	-24,55	OT 2Y	-0,041	0,02	31,00
JETFUEL	228,13	-2,87	-243,12	OT 5Y	0,425	0,03	45,40
DIESEL	279,98	-1,02	-174,52	OT 10Y	0,890	0,02	53,30
COBRE	4.930,00	181,50	-684,00	BUND 10Y	-0,885	1,23	18,40
ZINCO	1.897,75	32,00	-120,25	SCHATZ 2Y	-0,039	4,81	16,50
OURO	1.591,73	-6,17	6,04	T-NOTE 10Y	1,720	-4,36	-37,10
TRIGO	550,25	-18,50	25,25	T-NOTE 2Y	0,863	1,30	-43,50
LICENÇA C02	17,10	-0,58	-6,51	GILT 10Y	0,273	-4,68	-8,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0936	-0,18%	-1,67%	1,0970	1,0999	1,1058
EUR/GBP	0,8846	0,21%	-1,52%	0,8863	0,8882	0,8924
EUR/JPY	117,55	1,15%	1,93%	117,55	117,55	117,55
EUR/CHF	1,0582	0,14%	1,05%	1,0574	1,0568	1,0556
EUR/BRL	5,7488	-0,09%	-13,33%	5,7957	5,8342	5,9332
EUR/PLN	4,5920	-0,70%	-5,72%	4,6087	4,6185	4,6362



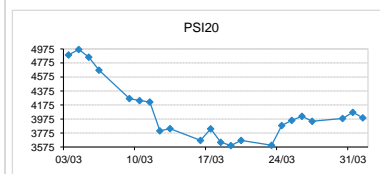
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0936	0,8846	117,55	1,0582	10,9814	7,4641	1,5550	1,7911	5,7488	11,4521
USD	0,9155	-	0,8049	107,135	0,9683	10,0187	6,8326	1,4207	1,6340	5,2352	10,3756

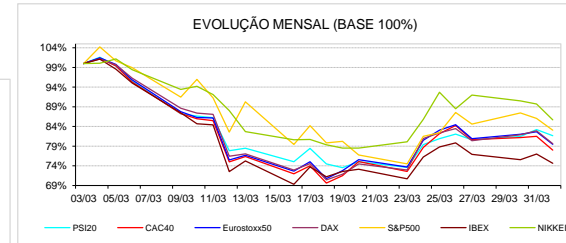
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	3,566	-1,55	-37,22
BCP	0,100	-2,44	-50,69
CORT. AMORIM	8,330	0,73	-26,28
CTT	2,235	-2,15	-29,94
EDP	3,570	-2,41	-7,61
EDP R	10,500	-4,37	0,00
GALP	10,210	-1,78	-31,48
IBERSOL	4,700	-1,26	-41,25
J MARTINS	15,685	-4,59	6,96
MOTA ENGIL	1,092	-0,73	-41,60
NAVIGATOR	2,128	-1,39	-38,29
NOS	3,068	0,52	-36,08
PHAROL	0,067	-1,91	-32,83
RAMADA	2,850	-1,38	-51,20
REN	2,305	-0,65	-15,26
SEMAPA	7,990	3,10	-41,76
SONAE CAP.	0,423	5,49	-43,82
SONAE SGPS	0,585	-0,76	-35,71

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE CAP.	5,49
SEMAPA	3,10
CORT. AMORIM	0,73
NOS	0,52
CTT	-2,15
EDP	-2,41
BCP	-2,44
EDP R	-4,37
J MARTINS	-4,59



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	3.992,69	-1,89%	-23,43%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.207,24	-4,30%	-29,62%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.680,30	-3,83%	-28,43%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	9.544,75	-3,94%	-27,96%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.495,22	-3,47%	-22,77%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.579,40	-3,04%	-31,10%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	18.065,41	-4,50%	-23,63%	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.