

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

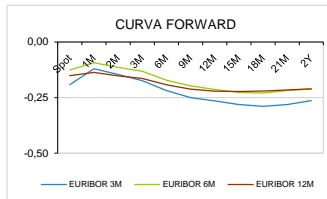
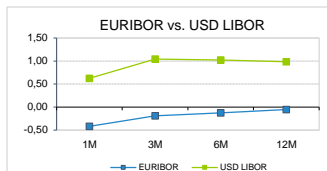
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

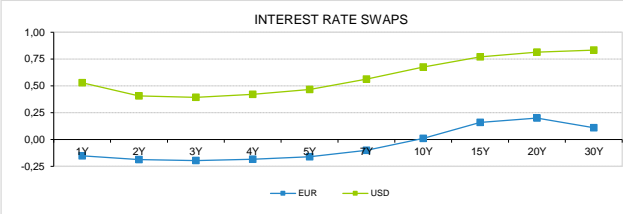
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4180	1	3	1M	0,6246	-4	-30	0,2498	-0,7262
3M	-0,1900	4	18	3M	1,0430	-5	-16	0,6459	-0,5868
6M	-0,1240	5	19	6M	1,0243	-5	3	0,7203	-0,5384
12M	-0,0530	3	13	12M	0,9865	0	5	0,8981	-0,4344

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,1514	4	17	-0,2274	-0,1514	-0,0065
2Y	-0,1870	4	12	-0,2246	-0,1105	0,0431
3Y	-0,1964	4	7	-0,1979	-0,0737	0,0880
4Y	-0,1835	5	3	-0,1655	-0,0321	0,1333
5Y	-0,1605	5	0	-0,1336	0,0101	0,1842
7Y	-0,1003	6	-3	-0,0565	0,0941	0,2422
10Y	0,0100	7	-2	0,0605	0,1965	0,3138
15Y	0,1595	7	1	0,1896	0,2637	0,3150
20Y	0,2000	6	2	0,2067	0,2341	0,2447
30Y	0,1093	6	3	0,0999	0,0982	0,0886

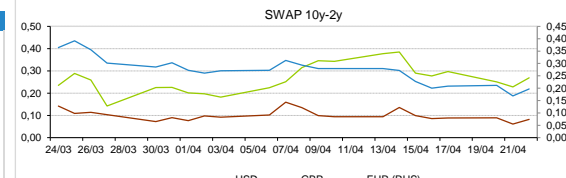
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,75
Austrália	0,25
Índia	3,00



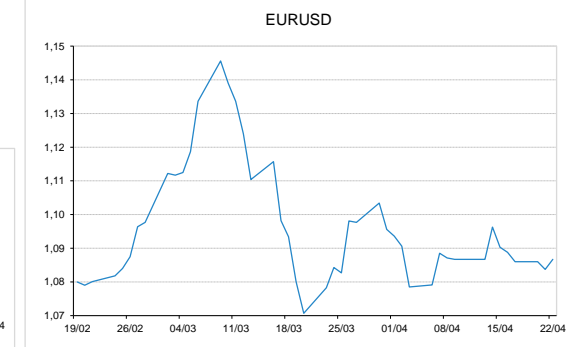
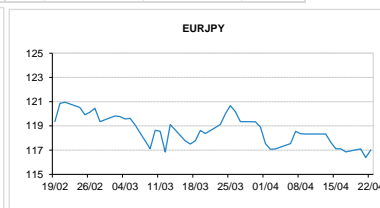
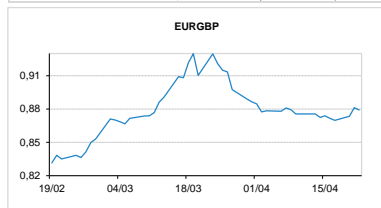
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,5297	-1	-9	0,3305	0,5315	0,7230
2Y	0,4064	0	-8	0,3180	0,5695	0,8045
3Y	0,3930	1	-8	0,3655	0,6180	0,7500
4Y	0,4213	1	-6	0,4440	0,6370	0,8673
5Y	0,4671	2	-5	0,4980	0,6740	0,8888
7Y	0,5627	3	-5	0,6090	0,7390	0,8510
10Y	0,6752	4	-4	0,7115	0,7895	0,8610
15Y	0,7706	4	1	0,7430	0,8806	0,9326
20Y	0,8140	4	5	0,7620	0,8873	0,9110
30Y	0,8333	4	6	0,8350	0,8694	0,8810



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	20,44	1,11	-8,56	OT 2Y	0,250	0,04	28,30
JETFUEL	149,17	-47,58	-114,38	OT 5Y	0,810	0,09	35,00
DIESEL	204,17	-46,08	-104,86	OT 10Y	1,277	0,12	31,70
COBRE	5.026,50	-153,50	220,00	BUND 10Y	-0,846	7,96	-4,40
ZINCO	1.903,25	-37,25	54,25	SCHATZ 2Y	-0,050	2,52	2,10
OURO	1.710,03	23,83	211,38	T-NOTE 10Y	1,732	3,23	-7,50
TRIGO	543,50	-2,75	7,75	T-NOTE 2Y	0,848	0,19	2,80
LICENÇA C02	20,67	0,82	4,56	GILT 10Y	0,282	2,89	-9,40


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0867	0,28%	0,78%	1,0890	1,0914	1,0964
EUR/GBP	0,8792	0,23%	5,74%	0,8806	0,8822	0,8859
EUR/JPY	117,01	-0,53%	1,79%	117,01	117,01	117,01
EUR/CHF	1,0516	0,12%	0,45%	1,0509	1,0499	1,0478
EUR/BRL	5,8426	-1,17%	-5,63%	5,8581	5,8748	5,9135
EUR/PLN	4,5517	-0,38%	1,23%	4,5631	4,5714	4,5875

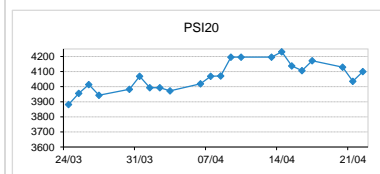

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0867	0,8792	117,01	1,0516	10,9335	7,4575	1,5309	1,71396	5,8426	11,6643
USD	0,9234	-	0,8111	107,79	0,9712	10,0893	6,8868	1,4153	1,5842	5,3906	10,7772

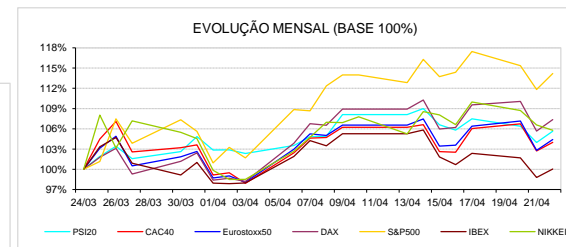
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,614	3,78	-18,77
BCP	0,094	2,07	-53,70
CORT. AMORIM	8,690	-0,23	-23,10
CTT	2,165	-1,14	-32,13
EDP	3,797	2,62	-1,73
EDP R	10,540	1,74	0,38
GALP	9,270	2,27	-37,79
IBERSOL	3,980	0,76	-50,25
J MARTINS	15,930	1,89	8,63
MOTA ENGL	1,082	-0,92	-42,14
NAVIGATOR	2,258	-0,35	-34,52
NOS	3,368	2,75	-29,83
PHAROL	0,066	0,15	-33,43
RAMADA	2,790	-1,06	-52,23
REN	2,405	0,21	-11,58
SEMAPA	8,760	1,51	-36,15
SONAE CAP.	0,477	-0,42	-36,65
SONAE SGPS	0,680	2,72	-25,27

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	3,78
NOS	2,75
SONAE SGPS	2,72
EDP	2,62
GALP	2,27
NAVIGATOR	-0,35
SONAE CAP.	-0,42
MOTA ENGL	-0,92
RAMADA	-1,06
CTT	-1,14



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.100,59	1,60%	-21,36%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.411,80	1,25%	-26,20%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.834,90	1,56%	-24,30%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	10.415,03	1,61%	-21,39%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.794,49	1,12%	-13,50%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.719,80	1,28%	-29,63%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	19.137,95	-0,74%	-19,10%	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.