

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

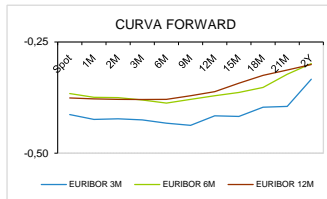
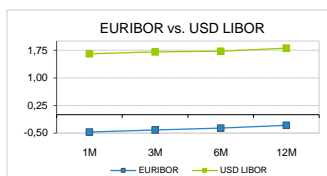
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

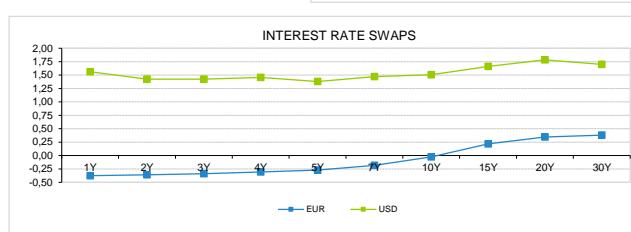
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4700	1	-1	1M	1,6528	-1	-2	0,7073	-0,7656
3M	-0,4130	0	-2	3M	1,7073	-1	-13	0,7586	-0,6952
6M	-0,3620	-1	-3	6M	1,7245	0	-15	0,8154	-0,6374
12M	-0,2880	-1	-4	12M	1,8071	1	-16	0,8906	-0,4988

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3760	-1	-5	-0,3622	-0,2209	-0,0237
2Y	-0,3580	0	-6	-0,3310	-0,1738	0,0372
3Y	-0,3380	1	-8	-0,2938	-0,1231	0,1020
4Y	-0,3060	1	-10	-0,2521	-0,0665	0,1663
5Y	-0,2710	1	-13	-0,2064	-0,0068	0,2285
7Y	-0,1840	0	-16	-0,0995	0,1133	0,3392
10Y	-0,0250	0	-19	0,0707	0,2779	0,4681
15Y	0,2160	1	-21	0,2955	0,4425	0,5649
20Y	0,3450	0	-21	0,4001	0,4919	0,5639
30Y	0,3800	0	-21	0,4075	0,4473	0,4749

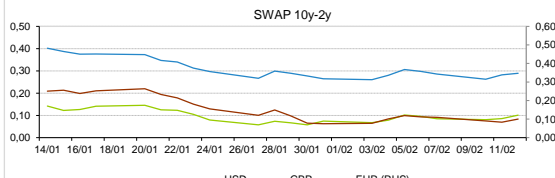
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,75
Índia	4,00



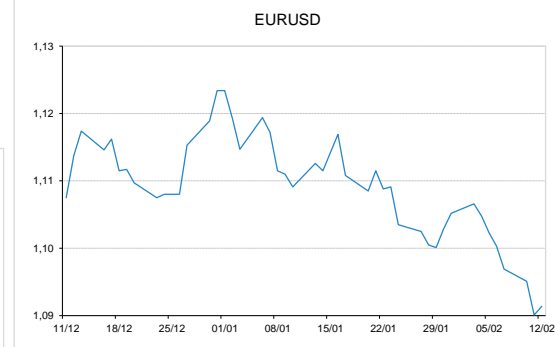
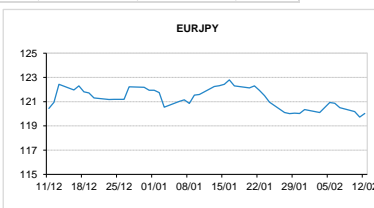
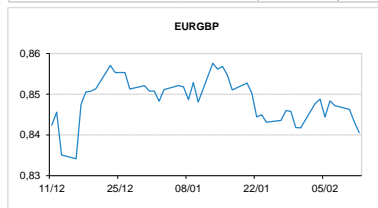
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,5620	-5	-18	1,3645	1,4020	1,5680
2Y	1,4240	-5	-21	1,3430	1,4460	1,6040
3Y	1,4250	-5	-16	1,3270	1,4860	1,6400
4Y	1,4570	3	-19	1,4126	1,5250	1,6725
5Y	1,3790	-5	-25	1,4462	1,5620	1,7254
7Y	1,4710	-6	-18	1,4980	1,6310	1,7580
10Y	1,5070	-5	-33	1,5930	1,7050	1,8020
15Y	1,6610	-6	-20	1,6930	1,7760	1,8430
20Y	1,7840	6	-12	1,7440	1,8020	1,8440
30Y	1,6980	-5	-34	1,7550	1,7932	1,8055



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	55,67	1,66	-8,58	OT 2Y	-0,424	-0,01	4,40
JETFUEL	536,86	20,71	-96,92	OT 5Y	-0,117	-0,01	-1,40
DIESEL	513,25	17,60	-85,00	OT 10Y	0,300	-0,01	-13,00
COBRE	5,725,00	78,00	-453,00	BUND 10Y	-1,005	1,22	-22,80
ZINCO	2,142,00	14,25	-241,00	SCHATZ 2Y	-0,005	0,00	-5,10
OURO	1,569,38	3,56	7,04	T-NOTE 10Y	2,508	2,72	-17,50
TRIGO	546,75	4,75	-17,75	T-NOTE 2Y	1,929	2,48	-11,80
LICENÇA C02	23,87	0,57	-0,34	GILT 10Y	0,522	4,26	-16,10


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0914	0,12%	-1,91%	1,0974	1,1033	1,1150
EUR/GBP	0,84058	0,32%	2,02%	0,8432	0,8457	0,8509
EUR/JPY	120,03	-0,25%	1,85%	120,03	120,03	120,03
EUR/CHF	1,0640	0,15%	1,56%	1,0632	1,0624	1,0606
EUR/BRL	4,7312	-0,04%	-2,46%	4,7722	4,8150	4,9228
EUR/PLN	4,2530	0,10%	-0,41%	4,2741	4,2966	4,3446

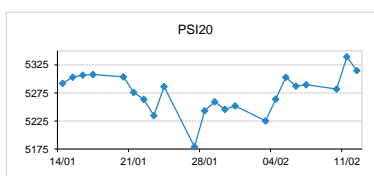

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0914	0,8406	120,03	1,0640	10,4839	7,4725	1,4425	1,61453	4,7312	10,0384
USD	0,9180	-	0,7707	110,015	0,9766	9,6245	6,8600	1,3260	1,4827	4,3440	9,2133

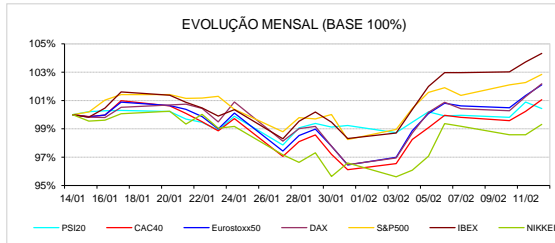
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,590	-2,87	-1,58
BCP	0,190	-0,78	-6,31
CORT. AMORIM	10,900	1,11	-3,54
CTT	2,902	-0,41	-9,03
EDP	4,645	-1,23	20,21
EDP R	12,120	-2,10	15,43
GALP	14,000	2,15	-6,04
IBERSOL	8,800	0,46	10,00
J MARTINS	16,490	0,76	12,44
MOTA ENGIL	1,680	-1,00	-10,16
NAVIGATOR	3,234	-4,88	-6,22
NOS	4,484	0,40	-6,58
PHAROL	0,100	0,10	0,10
RAMADA	5,600	0,36	-4,11
REN	2,725	-0,37	0,18
SEMAPA	12,580	-1,41	-8,31
SONAE CAP.	0,762	0,00	1,20
SONAE SGPS	0,843	0,06	-7,42

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
GALP	2,15
CORT. AMORIM	1,11
J MARTINS	0,76
IBERSOL	0,46
NOS	0,40
EDP	-1,23
SEMAPA	-1,41
EDP R	-2,10
ALTRI	-2,87
NAVIGATOR	-4,88



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.314,94	-0,46%	1,93%	5.429,32	4.699,20
CAC40	6.104,73	0,83%	2,12%	6.109,81	5.039,99
ESTX 50 PR	3.854,43	0,75%	2,92%	3.854,43	3.175,71
XTRA DAX	13.749,78	0,89%	3,78%	13.758,70	11.018,95
S&P 500	3.376,57	0,56%	4,51%	3.377,83	2.722,27
IBEX 35	9.940,40	0,58%	4,10%	9.946,60	8.409,20
NIKKEI 225	23.861,21	0,74%	0,86%	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.