

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

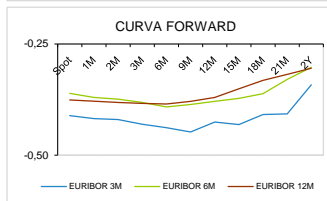
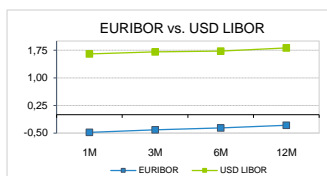
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

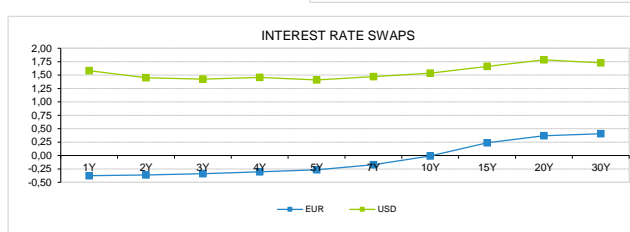
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4800	-1	-2	1M	1,6501	0	-3	0,7100	-0,7708
3M	-0,4110	0	-2	3M	1,7038	0	-13	0,7553	-0,6970
6M	-0,3570	1	-3	6M	1,7254	0	-15	0,8144	-0,6450
12M	-0,2870	0	-4	12M	1,8128	1	-15	0,8950	-0,5086

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3760	0	-5	-0,3705	-0,2267	-0,0368
2Y	-0,3630	-1	-6	-0,3373	-0,1804	0,0182
3Y	-0,3390	0	-8	-0,3002	-0,1325	0,0815
4Y	-0,3050	0	-10	-0,2586	-0,0818	0,1448
5Y	-0,2660	1	-12	-0,2142	-0,0240	0,2047
7Y	-0,1730	1	-15	-0,1131	0,0948	0,3163
10Y	-0,0080	2	-17	0,0539	0,2565	0,4452
15Y	0,2360	2	-19	0,2755	0,4189	0,5425
20Y	0,3690	2	-19	0,3784	0,4678	0,5409
30Y	0,4060	3	-19	0,3863	0,4249	0,4519

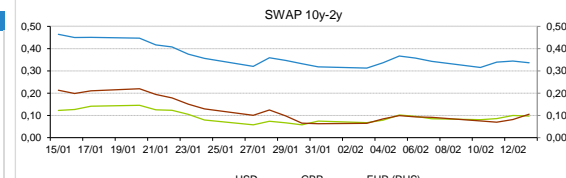
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,75
Índia	4,00



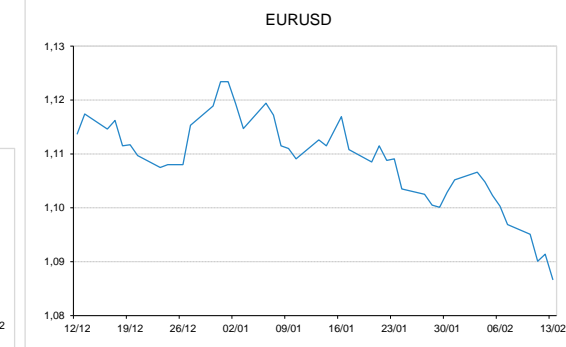
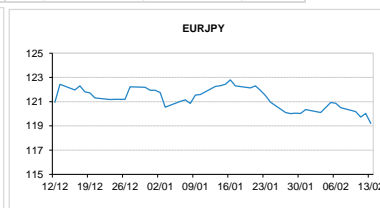
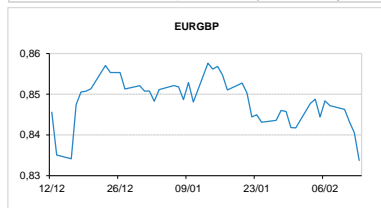
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,5810	2	-16	1,3636	1,4102	1,5540
2Y	1,4500	3	-18	1,2940	1,4360	1,5630
3Y	1,4250	-5	-16	1,3160	1,4905	1,6401
4Y	1,4570	3	-19	1,3470	1,5130	1,6749
5Y	1,4090	3	-22	1,3800	1,5634	1,7097
7Y	1,4710	-6	-18	1,4420	1,6320	1,7589
10Y	1,5360	3	-30	1,5810	1,6805	1,8070
15Y	1,6610	-6	-20	1,6425	1,7783	1,8475
20Y	1,7840	6	-12	1,7195	1,8002	1,8462
30Y	1,7290	3	-31	1,7539	1,7630	1,7595



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	56,23	0,44	-7,25	OT 2Y	-0,430	-0,01	4,50
JETFUEL	536,86	20,71	-96,92	OT 5Y	-0,118	0,00	-1,30
DIESEL	513,25	17,60	-85,00	OT 10Y	0,295	-0,01	-13,00
COBRE	5.763,00	19,00	-434,00	BUND 10Y	-1,015	-1,16	-21,80
ZINCO	2.141,50	-0,50	-241,50	SCHATZ 2Y	-0,011	-0,69	-5,90
OURO	1.577,15	8,89	27,39	T-NOTE 10Y	2,505	-0,61	-15,70
TRIGO	542,25	-6,25	-22,50	T-NOTE 2Y	1,929	0,00	-11,10
LICENÇA C02	24,39	0,51	0,25	GILT 10Y	0,571	4,19	-7,70


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0867	-0,43%	-2,33%	1,0926	1,0985	1,1100
EUR/GBP	0,83375	0,82%	2,86%	0,8363	0,8389	0,8440
EUR/JPY	119,21	0,69%	2,55%	119,21	119,21	119,21
EUR/CHF	1,0619	0,18%	1,76%	1,0611	1,0601	1,0584
EUR/BRL	4,7018	0,69%	-1,86%	4,7421	4,7841	4,8892
EUR/PLN	4,2471	0,12%	-0,28%	4,2682	4,2908	4,3386

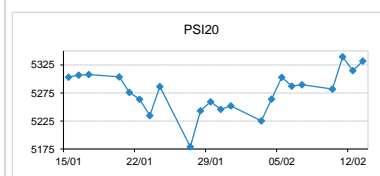

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0867	0,8338	119,21	1,0619	10,4970	7,4720	1,4382	1,61252	4,7018	10,0459
USD	0,9220	-	0,766	109,805	0,9785	9,6711	6,8890	1,3255	1,4857	4,3271	9,2600

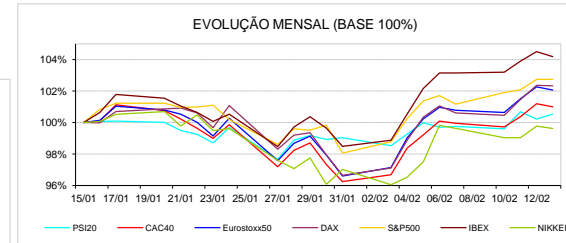
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,510	-1,43	-2,99
BCP	0,194	1,84	-4,59
CORT. AMORIM	10,780	-1,10	-4,60
CTT	2,890	-0,41	-9,40
EDP	4,655	0,22	20,47
EDP R	12,360	1,98	17,71
GALP	14,000	0,00	-6,04
IBERSOL	8,800	0,00	10,00
J MARTINS	16,660	1,03	13,60
MOTA ENGIL	1,663	-1,01	-11,07
NAVIGATOR	3,236	0,06	-6,16
NOS	4,438	-1,03	-7,54
PHAROL	0,100	0,00	0,10
RAMADA	5,600	0,00	-4,11
REN	2,735	0,37	0,55
SEMAPA	12,520	-0,48	-8,75
SONAE CAP.	0,763	0,13	1,33
SONAE SGPS	0,835	-0,89	-8,24

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP R	1,98
BCP	1,84
J MARTINS	1,03
REN	0,37
EDP	0,22
SONAE SGPS	-0,89
MOTA ENGIL	-1,01
NOS	-1,03
CORT. AMORIM	-1,10
ALTRI	-1,43



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.331,96	0,32%	2,26%	5.429,32	4.699,20
CAC40	6.093,14	-0,19%	1,93%	6.109,81	5.059,50
ESTX 50 PR	3.846,74	-0,20%	2,71%	3.854,43	3.175,71
XTRA DAX	13.745,43	-0,03%	3,75%	13.758,70	11.018,95
S&P 500	3.379,56	0,00%	4,61%	3.381,47	2.722,27
IBEX 35	9.909,80	-0,31%	3,78%	9.946,60	8.409,20
NIKKEI 225	23.827,73	-0,14%	0,72%	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.