

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

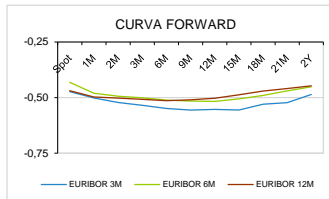
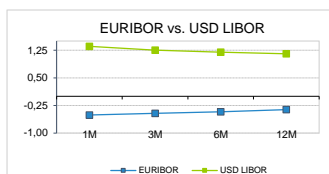
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

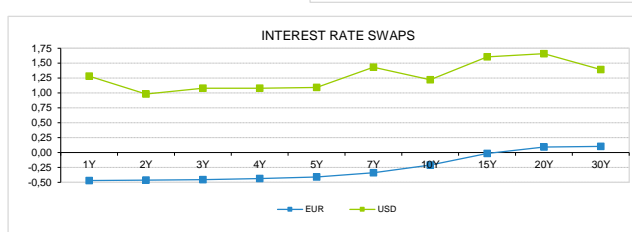
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5080	-2	-5	1M	1,3558	-16	-31	0,6178	-0,8410
3M	-0,4630	-3	-7	3M	1,2538	-21	-50	0,6014	-0,7690
6M	-0,4220	-2	-8	6M	1,1984	-20	-55	0,6081	-0,7566
12M	-0,3620	-4	-7	12M	1,1539	-23	-65	0,6759	-0,6550

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4695	-2	-10	-0,5002	-0,3802	-0,2153
2Y	-0,4640	-3	-10	-0,4736	-0,3431	-0,1661
3Y	-0,4550	-3	-11	-0,4422	-0,3001	-0,1138
4Y	-0,4360	-3	-13	-0,4081	-0,2540	-0,0612
5Y	-0,4090	-3	-13	-0,3693	-0,2051	-0,0080
7Y	-0,3400	-3	-15	-0,2808	-0,1048	0,0818
10Y	-0,2110	-3	-18	-0,1399	0,0324	0,1899
15Y	-0,0150	-3	-22	0,0482	0,1680	0,2669
20Y	0,0920	-3	-25	0,1329	0,2040	0,2593
30Y	0,1030	-3	-27	0,1205	0,1464	0,1625

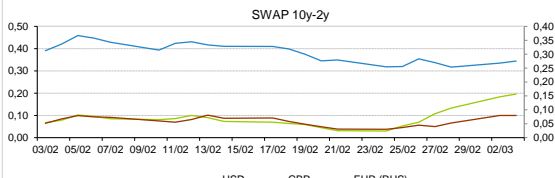
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,50
Índia	4,00



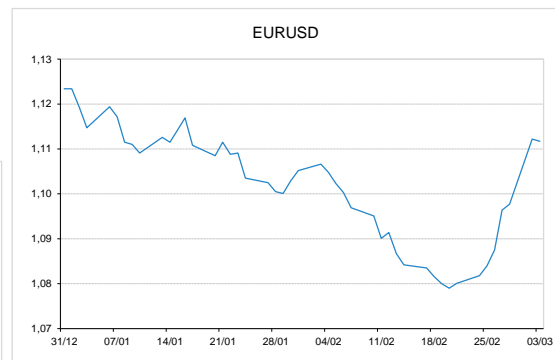
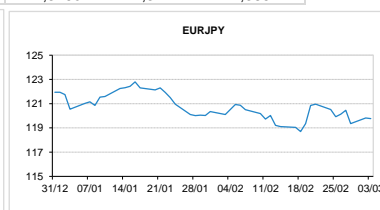
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,2810	-22	-36	0,8227	0,8730	1,0455
2Y	0,9820	-14	-54	0,7525	0,9140	1,0830
3Y	1,0790	-22	-57	0,7940	0,9590	1,1135
4Y	1,0800	-31	-35	0,8350	0,9975	1,1430
5Y	1,0930	-19	-34	0,8745	1,0330	1,1914
7Y	1,4310	-7	-31	0,9525	1,0990	1,2350
10Y	1,2200	-16	-62	1,0545	1,1860	1,2860
15Y	1,6050	-9	-35	1,1670	1,2550	1,3195
20Y	1,6590	-13	-35	1,2150	1,2790	1,3270
30Y	1,3910	-14	-65	1,2445	1,2759	1,2907



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	52,13	0,23	-2,48	OT 2Y	-0,422	-0,07	2,10
JETFUEL	478,42	0,07	-33,56	OT 5Y	-0,131	-0,10	0,30
DIESEL	464,04	2,39	-26,27	OT 10Y	0,256	-0,10	-1,00
COBRE	5.723,00	65,00	133,00	BUND 10Y	-1,260	-0,46	-19,00
ZINCO	2.012,75	-0,25	-192,25	SCHATZ 2Y	-0,178	0,46	-13,90
OURO	1.640,08	41,63	64,47	T-NOTE 10Y	2,034	-5,66	-39,30
TRIGO	528,00	4,75	-25,75	T-NOTE 2Y	1,240	-5,81	-48,00
LICENÇA C02	23,38	-0,14	0,17	GILT 10Y	0,326	-3,33	-17,00


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1117	-0,05%	0,46%	1,1166	1,1210	1,1295
EUR/GBP	0,8701	0,12%	-2,57%	0,8725	0,8749	0,8799
EUR/JPY	119,77	0,04%	0,28%	119,77	119,77	119,77
EUR/CHF	1,0687	0,07%	-0,02%	1,0678	1,0667	1,0648
EUR/BRL	5,0161	-0,68%	-6,37%	5,0609	5,1009	5,2049
EUR/PLN	4,3035	0,60%	-0,07%	4,3260	4,3474	4,3854

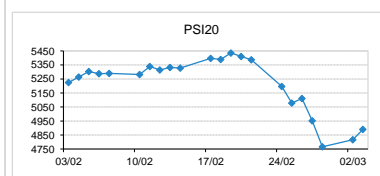

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1117	0,8701	119,77	1,0687	10,5378	7,4728	1,4928	1,69077	5,0161	10,3273
USD	0,8945	-	0,7804	107,525	0,9552	9,4092	6,6842	1,3338	1,5101	4,4604	9,2117

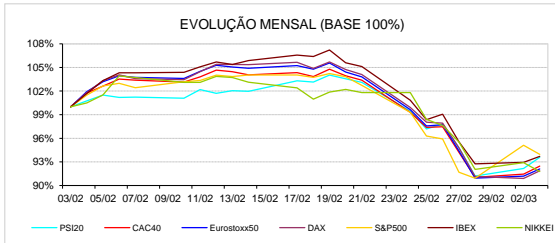
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,900	0,99	-13,73
BCP	0,159	-0,19	-21,45
CORT. AMORIM	10,060	1,62	-10,97
CTT	2,410	2,99	-24,45
EDP	4,471	3,57	15,71
EDP R	12,700	3,25	20,95
GALP	12,855	1,58	-13,72
IBERSOL	7,840	0,77	-2,00
J MARTINS	16,125	0,81	9,96
MOTA ENGIL	1,321	1,30	-29,36
NAVIGATOR	2,838	0,92	-17,70
NOS	3,556	0,97	-25,92
PHAROL	0,084	1,82	-15,56
RAMADA	4,720	2,39	-19,18
REN	2,650	-0,38	-2,57
SEMAPA	11,420	1,60	-16,76
SONAE CAP.	0,683	4,92	-9,30
SONAE SGPS	0,736	0,82	-19,18
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE CAP.	4,92
EDP	3,57
EDP R	3,25
CTT	2,99
RAMADA	2,39
BCP	-0,19
REN	-0,38



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.890,02	1,53%	-6,22%	5.454,21	4.699,20
CAC40	5.393,17	1,12%	-9,78%	6.111,41	5.152,30
ESTX 50 PR	3.371,97	0,99%	-9,96%	3.867,28	3.239,20
XTRA DAX	11.985,39	1,08%	-9,54%	13.795,24	11.266,48
S&P 500	3.051,63	-1,24%	-5,54%	3.393,52	2.722,27
IBEX 35	8.811,60	0,80%	-7,72%	10.100,20	8.409,20
NIKKEI 225	21.082,73	-1,22%	-10,88%	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.