

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

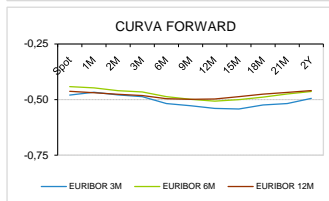
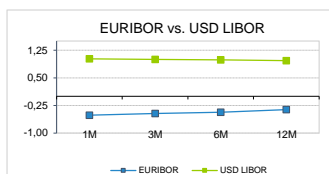
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

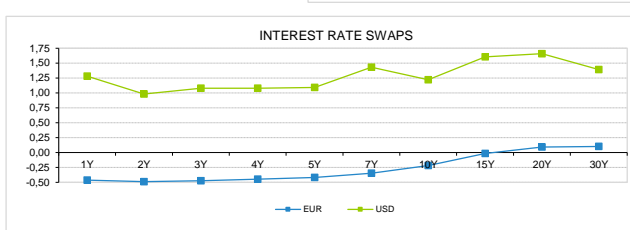
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5130	-1	-5	1M	1,0163	-36	-65	0,5066	-0,8444
3M	-0,4690	0	-7	3M	1,0006	-31	-74	0,5030	-0,7914
6M	-0,4320	-1	-9	6M	0,9889	-26	-75	0,5045	-0,7622
12M	-0,3620	0	-8	12M	0,9675	-28	-84	0,5853	-0,6662

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4635	1	-10	-0,4990	-0,4068	-0,2400
2Y	-0,4880	-4	-13	-0,4853	-0,3685	-0,1876
3Y	-0,4720	-4	-13	-0,4592	-0,3235	-0,1331
4Y	-0,4460	-4	-14	-0,4241	-0,2765	-0,0805
5Y	-0,4180	-4	-14	-0,3871	-0,2275	-0,0300
7Y	-0,3480	-5	-16	-0,2990	-0,1246	0,0651
10Y	-0,2190	-6	-19	-0,1573	0,0145	0,1758
15Y	-0,0160	-6	-23	0,0340	0,1538	0,2550
20Y	0,0920	0	-25	0,1195	0,1913	0,2480
30Y	0,1020	-6	-28	0,1101	0,1374	0,1554

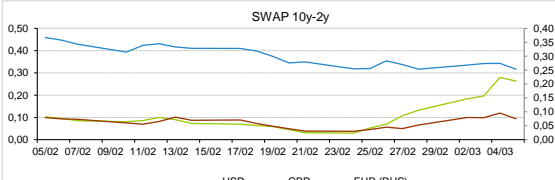
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,50
Índia	4,00



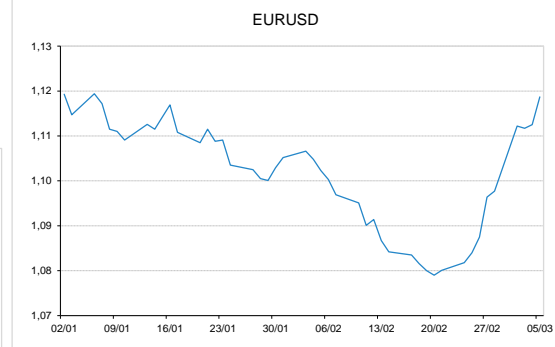
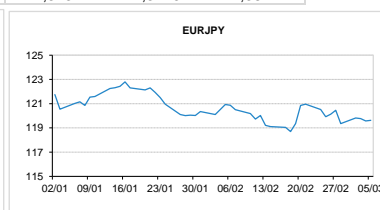
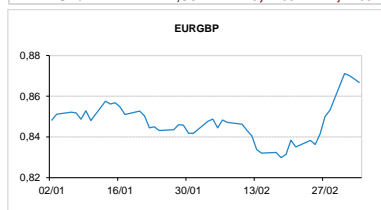
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,2810	-22	-36	0,6053	0,7918	0,9590
2Y	0,9820	-14	-54	0,6464	0,8280	0,9960
3Y	1,0790	-22	-57	0,6947	0,8730	1,0320
4Y	1,0800	-31	-35	0,7175	0,9199	1,0670
5Y	1,0930	-19	-34	0,7770	0,9480	1,1150
7Y	1,4310	-7	-31	0,8660	1,0311	1,1555
10Y	1,2200	-16	-62	0,9690	1,1170	1,2110
15Y	1,6050	-9	-35	1,0970	1,1820	1,2580
20Y	1,6590	-13	-35	1,1435	1,2110	1,2545
30Y	1,3910	-14	-65	1,1640	1,1998	1,2141



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	50,89	-0,24	-4,54	OT 2Y	-0,414	0,03	-0,10
JETFUEL	466,95	-8,85	-71,34	OT 5Y	-0,093	0,04	1,40
DIESEL	457,21	-8,04	-55,92	OT 10Y	0,297	0,05	-1,20
COBRE	5.695,00	17,50	66,00	BUND 10Y	-1,125	-5,30	-27,70
ZINCO	1.964,25	5,50	-206,00	SCHATZ 2Y	-0,231	-1,82	-21,30
OURO	1.661,47	19,38	103,64	T-NOTE 10Y	1,958	-5,04	-54,70
TRIGO	522,25	4,00	-36,75	T-NOTE 2Y	1,112	-5,04	-70,90
LICENÇA C02	23,81	-0,02	0,04	GILT 10Y	0,284	-3,92	-24,60


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1187	0,56%	1,49%	1,1233	1,1269	1,1344
EUR/GBP	0,8667	0,21%	-2,57%	0,8691	0,8714	0,8761
EUR/JPY	119,63	-0,04%	1,10%	119,63	119,63	119,63
EUR/CHF	1,0621	0,16%	0,81%	1,0611	1,0600	1,0579
EUR/BRL	5,2119	-2,16%	-10,53%	5,2568	5,2985	5,4055
EUR/PLN	4,3012	-0,17%	-1,27%	4,3237	4,3446	4,3844

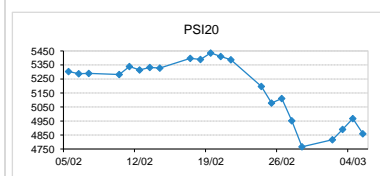

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1187	0,8667	119,63	1,0621	10,5853	7,4700	1,5001	1,69637	5,2119	10,3917
USD	0,8939	-	0,7737	106,675	0,9506	9,4575	6,6769	1,3398	1,5141	4,6483	9,2878

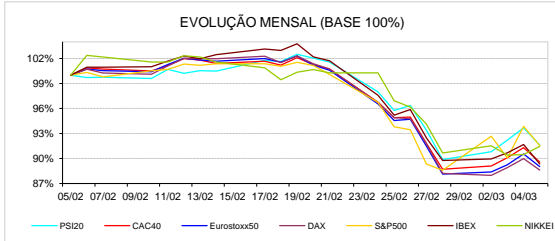
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,864	-3,11	-14,37
BCP	0,149	-5,09	-26,43
CORT. AMORIM	10,020	-1,76	-11,33
CTT	2,306	-3,35	-27,71
EDP	4,583	-2,49	18,61
EDP R	13,160	0,30	25,33
GALP	12,380	-2,90	-16,91
IBERSOL	7,880	0,00	-1,50
J MARTINS	16,325	-0,76	11,32
MOTA ENGIL	1,230	-6,89	-34,22
NAVIGATOR	2,762	-3,83	-19,91
NOS	3,472	-3,23	-27,67
PHAROL	0,082	-2,61	-17,67
RAMADA	4,600	-3,16	-21,23
REN	2,650	-0,56	-2,57
SEMAPA	11,400	-1,55	-16,91
SONAE CAP.	0,655	-2,67	-13,01
SONAE SGPS	0,723	-2,03	-20,55

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP R	0,30
NOS	-3,23
CTT	-3,35
NAVIGATOR	-3,83
BCP	-5,09
MOTA ENGIL	-6,89



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.858,80	-2,20%	-6,81%	5.454,21	4.699,20
CAC40	5.361,10	-1,90%	-10,32%	6.111,41	5.152,30
ESTX 50 PR	3.363,58	-1,67%	-10,19%	3.867,28	3.239,20
XTRA DAX	11.944,72	-1,51%	-9,84%	13.795,24	11.266,48
S&P 500	3.053,85	-2,46%	-5,50%	3.393,52	2.722,27
IBEX 35	8.683,00	-2,55%	-9,07%	10.100,20	8.409,20
NIKKEI 225	21.329,12	1,09%	-9,84%	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.