

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

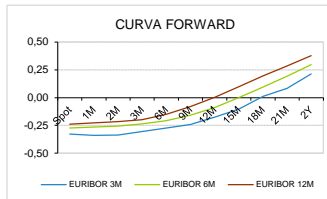
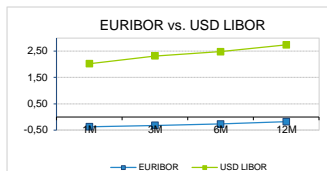
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

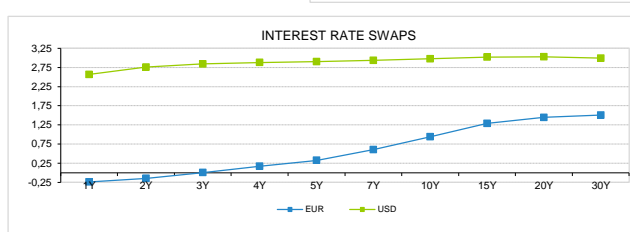
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	2,0245	1	10	0,5008	-0,7896
3M	-0,3210	0	1	3M	2,3192	1	-5	0,6280	-0,7328
6M	-0,2690	0	0	6M	2,4796	0	-4	0,7419	-0,6460
12M	-0,1800	0	1	12M	2,7389	0	-4	0,9236	-0,5258

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2392	1	2	0,0022	0,7437	1,2777
2Y	-0,1440	-1	1	0,1880	0,8950	1,3875
3Y	0,0080	-1	-2	0,3729	1,0220	1,4855
4Y	0,1700	-1	-3	0,5400	1,1390	1,5780
5Y	0,3250	-1	-4	0,6853	1,2460	1,6435
7Y	0,6060	-1	-4	0,9383	1,4247	1,7663
10Y	0,9420	0	-3	1,2245	1,6073	1,8660
15Y	1,2880	0	-2	1,4930	1,7525	1,9202
20Y	1,4450	0	-1	1,6045	1,7859	1,8899
30Y	1,5050	0	-1	1,6240	1,7419	1,8045

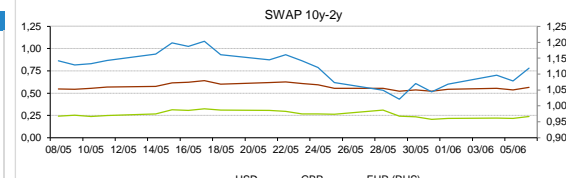
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



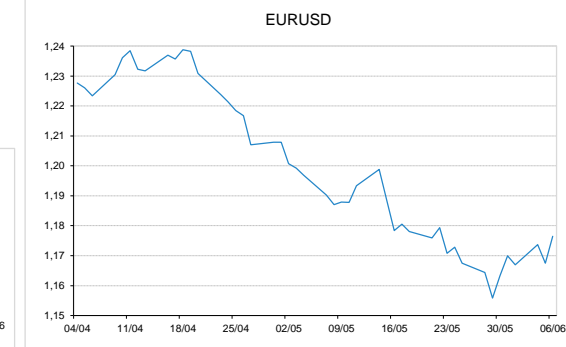
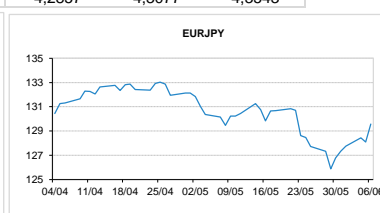
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5660	2	1	2,9956	3,0070	3,0280
2Y	2,7590	3	0	2,9980	3,0300	3,0470
3Y	2,8420	3	0	2,9895	3,0060	3,0630
4Y	2,8810	3	0	2,9905	3,0335	3,0650
5Y	2,9030	4	0	3,0155	3,0230	3,1243
7Y	2,9330	3	0	3,0305	3,0510	3,0805
10Y	2,9760	3	0	3,0947	3,1020	3,1195
15Y	3,0210	3	0	3,0540	3,1015	3,0810
20Y	3,0280	3	-1	3,0440	3,0770	3,0710
30Y	2,9920	3	-1	2,9970	3,0115	2,9875



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	75,08	-0,30	0,56	OT 2Y	0,005	0,01	18,50
JETFUEL	697,80	-1,99	-2,20	OT 5Y	0,784	0,10	22,40
DIESEL	656,80	-2,24	2,55	OT 10Y	1,946	0,09	27,20
COBRE	7.117,00	124,00	273,00	BUND 10Y	-0,011	9,71	-7,70
ZINCO	3.220,00	74,00	165,00	SCHATZ 2Y	0,023	3,90	-8,30
OURO	1.299,35	0,83	-14,08	T-NOTE 10Y	3,675	4,22	0,50
TRIGO	523,25	13,25	-3,00	T-NOTE 2Y	2,961	3,12	-2,40
LICENÇA C02	15,92	0,15	2,90	GILT 10Y	1,612	8,40	-3,50


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1765	0,77%	-1,15%	1,1850	1,1938	1,2136
EUR/GBP	0,87683	-0,33%	0,37%	0,8793	0,8821	0,8882
EUR/JPY	129,57	-1,15%	0,45%	129,57	129,57	129,57
EUR/CHF	1,1594	-0,54%	3,16%	1,1582	1,1570	1,1548
EUR/BRL	4,4913	-0,60%	-5,75%	4,5612	4,6325	4,7865
EUR/PLN	4,2631	0,38%	-0,04%	4,2857	4,3077	4,3543

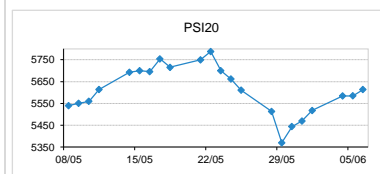

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1765	0,8768	129,57	1,1594	10,2828	7,4454	1,5203	1,53471	4,4913	9,5148
USD	0,8489	-	0,7446	110,035	0,9854	8,7323	6,3193	1,2908	1,3042	3,8263	8,0874

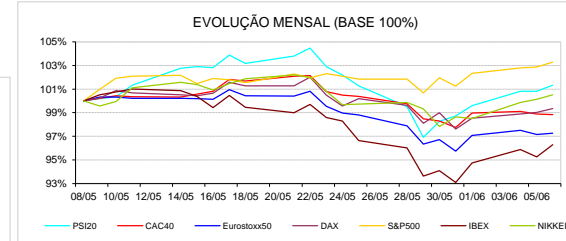
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,180	2,25	58,19
BCP	0,269	0,26	-1,10
CORT. AMORIM	11,4000	-1,55	10,68
CTT	2,8580	0,42	-18,51
EDP	3,410	-0,29	18,20
EDP R	8,220	0,49	17,98
GALP	16,175	1,47	5,55
IBERSOL	10,750	-3,59	-11,52
J MARTINS	13,520	0,00	-16,52
MOTA ENGIL	3,315	-0,60	-9,50
NAVIGATOR	5,640	0,80	32,64
NOS	4,660	0,04	-14,98
NOVABASE	2,750	-0,36	-9,81
PHAROL	0,262	-1,87	4,80
REN	2,356	-0,59	-4,96
SEMAPA	22,750	2,25	27,84
SONAE CAP.	0,950	0,21	7,10
SONAE SGPS	1,103	3,67	-2,04

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
SONAE SGPS	3,67
ALTRI	2,25
SEMAPA	2,25
GALP	1,47
NAVIGATOR	0,80
REN	-0,59
MOTA ENGIL	-0,60
CORT. AMORIM	-1,55
PHAROL	-1,87
IBERSOL	-3,59



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.613,46	0,52%	4,18%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.457,56	-0,06%	2,73%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.460,82	0,12%	-1,23%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.830,07	0,34%	-0,68%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.759,37	0,38%	3,20%	2.872,87	2.405,70
IBEX 35	9.791,60	1,09%	-2,51%	11.048,00	9.327,60
NIKKEI 225	22.625,73	0,38%	-0,61%	24.129,34	19.239,52



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.