

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

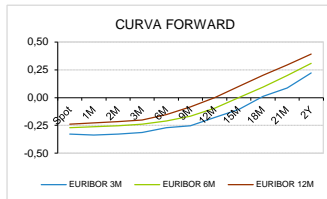
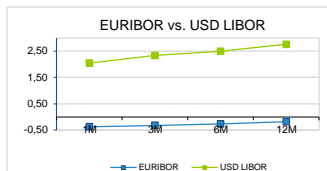
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

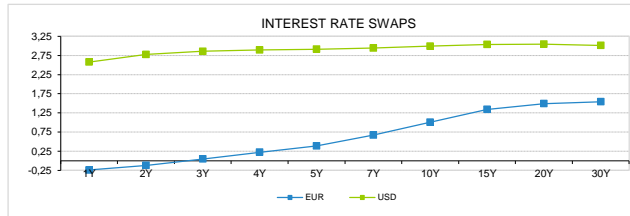
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	2,0474	0	13	0,4986	-0,7936
3M	-0,3210	0	1	3M	2,3326	1	-1	0,6247	-0,7332
6M	-0,2670	0	0	6M	2,4931	0	-2	0,7573	-0,6446
12M	-0,1810	0	1	12M	2,7579	2	-1	0,9270	-0,5234

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2400	0	1	-0,0014	0,7580	1,3040
2Y	-0,1180	0	2	0,1942	0,9040	1,4045
3Y	0,0490	1	1	0,3828	1,0370	1,4980
4Y	0,2230	1	0	0,5480	1,1520	1,5810
5Y	0,3870	2	0	0,6970	1,2570	1,6488
7Y	0,6720	2	0	0,9480	1,4305	1,7715
10Y	1,0060	2	2	1,2295	1,6133	1,8650
15Y	1,3430	2	2	1,4952	1,7541	1,9145
20Y	1,4920	2	2	1,6041	1,7822	1,8800
30Y	1,5430	1	2	1,6158	1,7315	1,7915

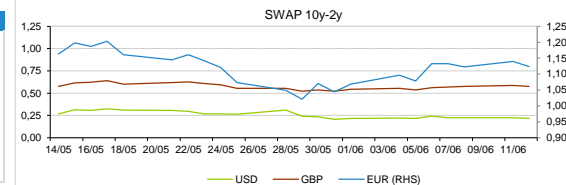
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



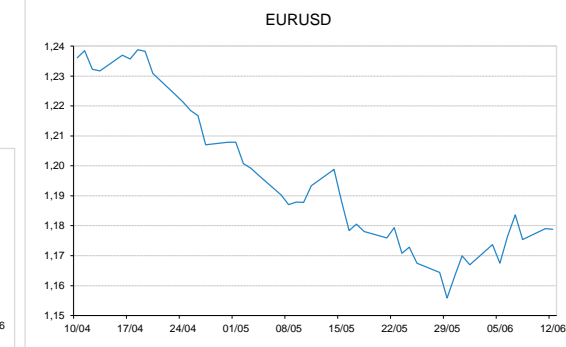
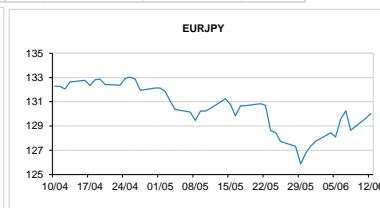
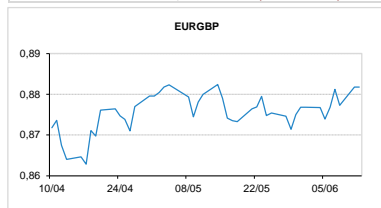
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5790	-1	1	3,0143	3,0530	3,0220
2Y	2,7740	-2	0	3,0411	3,0462	3,0365
3Y	2,8570	-3	-1	3,0190	3,0250	3,0480
4Y	2,8940	-3	-2	3,0065	3,0536	3,0630
5Y	2,9120	-3	-3	3,0335	3,0320	3,1087
7Y	2,9440	-3	-3	3,0340	3,0555	3,1010
10Y	2,9910	-3	-2	3,0665	3,0920	3,1135
15Y	3,0370	-3	-2	3,0685	3,0910	3,0840
20Y	3,0450	-3	-3	3,1013	3,0760	3,0700
30Y	3,0100	-2	-3	3,0290	3,0210	3,0100



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	76,50	0,04	-0,44	OT 2Y	-0,050	-0,01	14,00
JETFUEL	713,41	0,74	-14,59	OT 5Y	0,815	-0,01	26,60
DIESEL	671,75	2,08	-10,00	OT 10Y	1,987	-0,01	30,80
COBRE	7.222,00	-57,00	313,00	BUND 10Y	0,015	-0,45	-8,60
ZINCO	3.229,00	5,50	149,50	SCHATZ 2Y	0,037	1,15	-6,40
OURO	1.297,46	-2,85	-24,61	T-NOTE 10Y	3,670	0,84	-3,00
TRIGO	515,50	1,00	16,75	T-NOTE 2Y	2,969	0,78	-5,90
LICENÇA C02	15,12	-0,37	0,49	GILT 10Y	1,634	-0,68	-5,70


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1788	-0,02%	-1,67%	1,1871	1,1959	1,2158
EUR/GBP	0,88175	0,01%	0,07%	0,8841	0,8868	0,8929
EUR/JPY	130,03	-0,32%	0,95%	130,03	130,03	130,03
EUR/CHF	1,1600	0,16%	3,04%	1,1589	1,1577	1,1553
EUR/BRL	4,3394	0,82%	-0,42%	4,4113	4,4789	4,6416
EUR/PLN	4,2739	-0,09%	-0,02%	4,2961	4,3184	4,3650

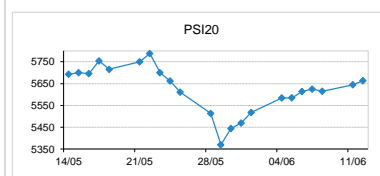

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1788	0,8818	130,03	1,1600	10,1507	7,4508	1,5312	1,55022	4,3394	9,4515
USD	0,8485	-	0,7488	110,285	0,9845	8,6105	6,3218	1,2988	1,3136	3,7132	8,0155

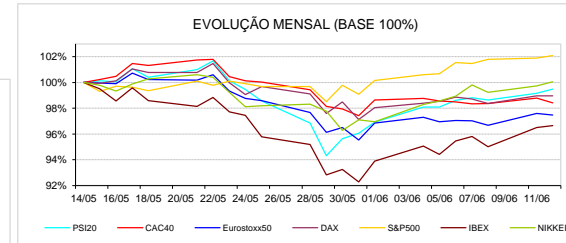
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	8,690	0,00	68,05
BCP	0,275	0,29	0,92
CORT. AMORIM	11,4200	0,35	10,87
CTT	2,9100	4,08	-17,02
EDP	3,400	0,83	17,85
EDP R	8,090	-1,88	16,12
GALP	16,255	0,03	6,07
IBERSOL	10,850	-0,91	-10,70
J MARTINS	13,285	-0,04	-17,97
MOTA ENGIL	3,240	1,25	-11,55
NAVIGATOR	5,930	-0,17	39,46
NOS	4,722	1,33	-13,85
NOVABASE	2,750	-0,36	-9,81
PHAROL	0,257	-1,15	2,80
REN	2,342	0,26	-5,53
SEMAPA	23,950	1,91	34,59
SONAE CAP.	0,936	0,11	5,52
SONAE SGPS	1,120	1,54	-0,53

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	4,08
SEMAPA	1,91
SONAE SGPS	1,54
NOS	1,33
MOTA ENGIL	1,25
NAVIGATOR	-0,17
NOVABASE	-0,36
IBERSOL	-0,91
PHAROL	-1,15
EDP R	-1,88



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.662,93	0,32%	5,10%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.453,37	-0,38%	2,65%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.475,58	-0,13%	-0,81%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.842,30	0,00%	-0,58%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.787,41	0,20%	4,26%	2.872,87	2.405,70
IBEX 35	9.914,40	0,16%	-1,29%	10.937,00	9.327,60
NIKKEI 225	22.878,35	0,33%	0,50%	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.