

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

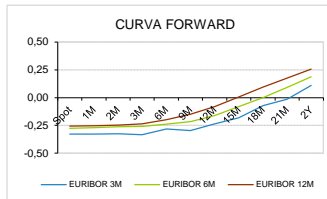
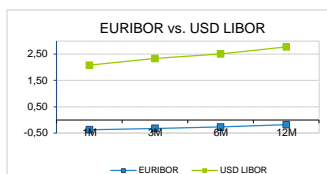
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

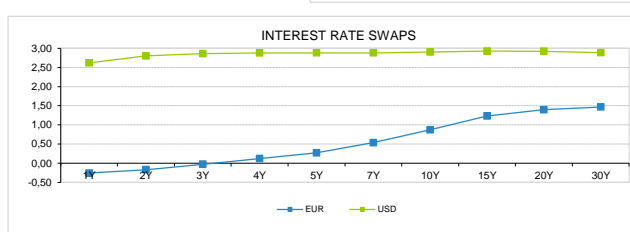
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3700	0	0	1M	2,0775	-1	3	0,5415	-0,7762
3M	-0,3210	0	0	3M	2,3331	0	1	0,7188	-0,7306
6M	-0,2690	0	0	6M	2,5088	0	2	0,8324	-0,6470
12M	-0,1800	0	0	12M	2,7759	0	4	1,0051	-0,5184

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2570	0	-2	-0,0808	0,5890	1,1150
2Y	-0,1680	0	-5	0,0876	0,7310	1,2300
3Y	-0,0260	1	-7	0,2545	0,8590	1,3405
4Y	0,1240	0	-9	0,4080	0,9790	1,4348
5Y	0,2680	0	-10	0,5485	1,0895	1,5120
7Y	0,5370	0	-12	0,7990	1,2820	1,6330
10Y	0,8730	0	-11	1,0979	1,4849	1,7610
15Y	1,2310	0	-9	1,3854	1,6498	1,8310
20Y	1,3960	0	-8	1,5113	1,6960	1,8100
30Y	1,4670	0	-7	1,5450	1,6660	1,7360

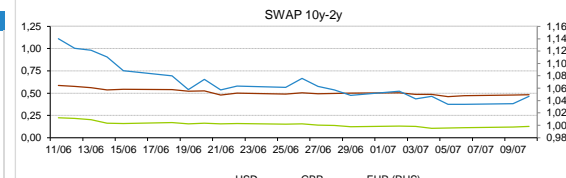
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



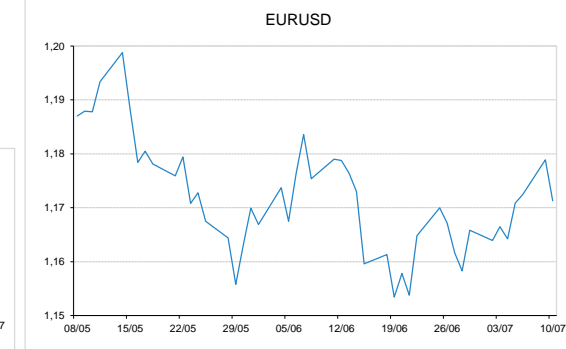
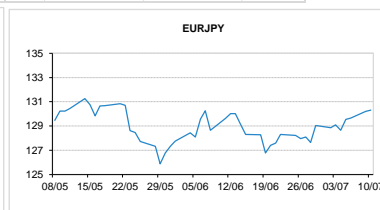
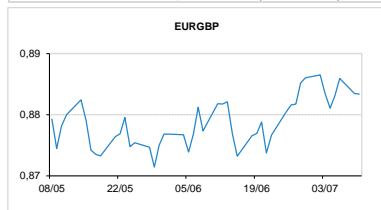
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6180	0	4	3,0129	2,9578	2,9295
2Y	2,8000	0	2	3,0109	2,9280	2,9220
3Y	2,8600	0	-1	2,9710	2,9418	2,9605
4Y	2,8760	0	-4	2,9580	2,9250	2,9761
5Y	2,8790	0	-6	2,9680	2,9310	2,9916
7Y	2,8810	0	-9	2,9727	2,9782	2,9860
10Y	2,9030	-1	-12	2,9941	2,9610	3,0182
15Y	2,9260	-1	-14	3,0051	3,0006	2,9780
20Y	2,9210	-1	-15	2,9942	2,9839	2,9785
30Y	2,8850	-1	-16	2,9270	2,9100	2,8970



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	78,79	0,72	2,60	OT 2Y	-0,097	-0,02	-12,20
JETFUEL	726,33	6,17	11,86	OT 5Y	0,602	-0,02	-31,40
DIESEL	681,08	7,17	9,86	OT 10Y	1,755	-0,03	-30,10
COBRE	6.405,00	108,00	-922,00	BUND 10Y	-0,177	1,70	-14,70
ZINCO	2.717,00	-46,00	-493,50	SCHATZ 2Y	-0,011	0,92	0,50
OURO	1.255,87	-3,22	-42,29	T-NOTE 10Y	3,591	0,34	-5,30
TRIGO	490,25	-17,75	-46,50	T-NOTE 2Y	2,973	0,78	4,30
LICENÇA C02	16,11	0,11	0,29	GILT 10Y	1,520	2,11	-10,70


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1713	-0,64%	-0,65%	1,1794	1,1888	1,2075
EUR/GBP	0,88338	0,01%	-0,18%	0,8859	0,8889	0,8951
EUR/JPY	130,3	-0,07%	-0,52%	130,30	130,30	130,30
EUR/CHF	1,1641	0,11%	-0,20%	1,1630	1,1616	1,1594
EUR/BRL	4,4869	1,27%	-2,52%	4,5585	4,6258	4,7761
EUR/PLN	4,3174	-0,07%	-1,11%	4,3408	4,3649	4,4123

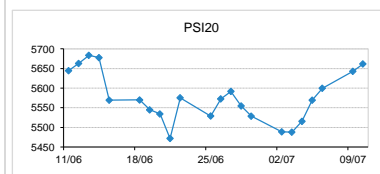

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1713	0,8834	130,30	1,1641	10,2598	7,4533	1,5386	1,57132	4,4869	9,4219
USD	0,8532	-	0,7537	111,245	0,9935	8,7556	6,3594	1,3127	1,3399	3,8412	8,0439

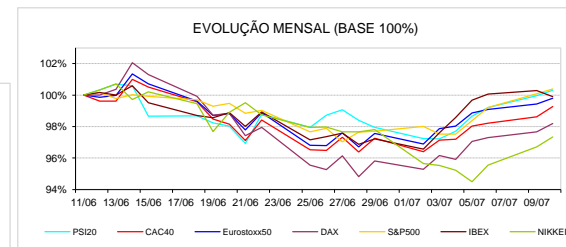
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,970	2,75	73,47
BCP	0,257	-0,77	-5,37
CORT. AMORIM	11,5800	1,76	12,43
CTT	2,9300	-0,61	-16,45
EDP	3,490	-0,06	20,97
EDP R	9,085	0,33	30,40
GALP	17,265	0,44	12,66
IBERSOL	12,300	0,00	1,23
J MARTINS	12,695	0,87	-21,61
MOTA ENGIL	3,090	0,98	-15,64
NAVIGATOR	5,100	0,59	20,85
NOS	4,958	0,98	-9,54
NOVABASE	2,710	-1,09	-11,12
PHAROL	0,243	-0,82	-2,80
REN	2,478	0,16	-0,04
SEMAPA	22,800	-0,87	28,13
SONAE CAP.	0,939	0,43	5,86
SONAE SGPS	1,023	0,10	-9,15

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	2,75
CORT. AMORIM	1,76
MOTA ENGIL	0,98
NOS	0,98
J MARTINS	0,87
CTT	-0,61
BCP	-0,77
PHAROL	-0,82
SEMAPA	-0,87
NOVABASE	-1,09



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.661,81	0,34%	5,08%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.434,36	0,67%	2,29%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.473,31	0,37%	-0,87%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.609,85	0,53%	-2,38%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.792,58	0,31%	4,45%	2.872,87	2.412,79
IBEX 35	9.889,30	-0,38%	-1,54%	10.758,20	9.327,60
NIKKEI 225	22.196,89	0,66%	-2,50%	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.