

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

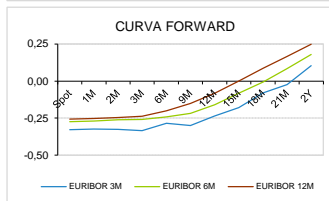
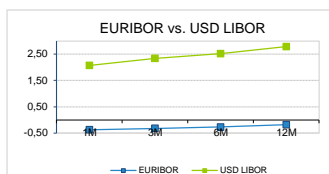
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

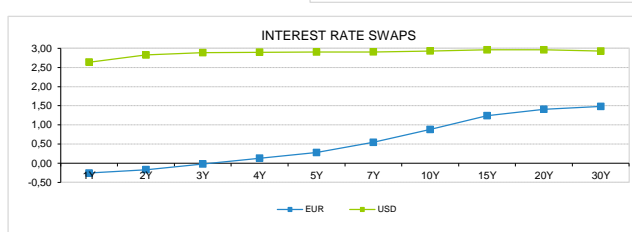
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,0716	0	1	0,5566	-0,7742
3M	-0,3210	0	0	3M	2,3392	0	0	0,7309	-0,7206
6M	-0,2680	0	0	6M	2,5196	1	2	0,8425	-0,6470
12M	-0,1790	0	0	12M	2,7853	1	2	1,0103	-0,5158

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2570	0	-1	-0,0824	0,5628	1,0930
2Y	-0,1670	0	-5	0,0833	0,7007	1,2060
3Y	-0,0230	1	-8	0,2411	0,8316	1,3130
4Y	0,1300	1	-10	0,3878	0,9530	1,4165
5Y	0,2770	1	-12	0,5285	1,0665	1,4925
7Y	0,5450	1	-14	0,7797	1,2610	1,6295
10Y	0,8810	1	-14	1,0792	1,4643	1,7430
15Y	1,2380	1	-12	1,3684	1,6326	1,8170
20Y	1,4060	1	-10	1,4974	1,6831	1,7980
30Y	1,4810	1	-8	1,5361	1,6618	1,7378

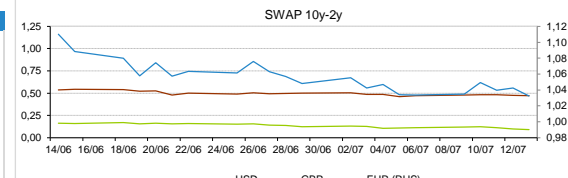
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



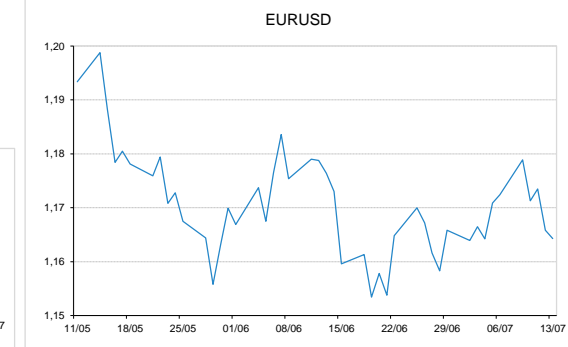
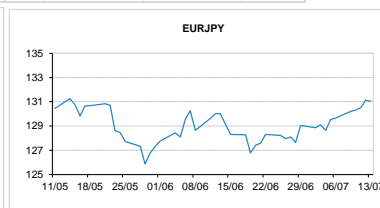
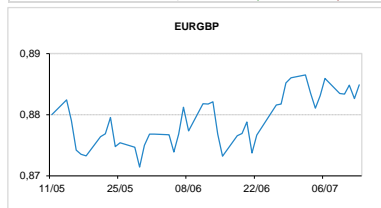
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6380	1	4	2,9878	2,9032	2,8540
2Y	2,8250	1	3	2,9430	2,8878	2,8605
3Y	2,8830	0	0	2,9459	2,8600	2,8725
4Y	2,8980	0	-2	2,9289	2,8625	2,8825
5Y	2,9000	0	-4	2,9189	2,8680	2,9324
7Y	2,9060	-1	-7	2,8920	2,8930	2,9310
10Y	2,9310	-1	-9	2,9391	2,9190	2,9390
15Y	2,9600	-1	-10	2,9310	2,9280	2,9280
20Y	2,9580	-2	-11	2,9190	2,9090	2,9306
30Y	2,9260	-2	-11	2,8830	2,8620	2,8550



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	75,11	0,66	-1,37	OT 2Y	-0,120	-0,03	-2,80
JETFUEL	700,59	11,34	-11,41	OT 5Y	0,542	-0,03	-23,80
DIESEL	657,84	12,51	-13,41	OT 10Y	1,735	-0,01	-21,30
COBRE	6.215,00	83,00	-994,00	BUND 10Y	-0,219	-1,32	-21,40
ZINCO	2.589,50	2,50	-621,25	SCHATZ 2Y	-0,011	0,23	-4,50
OURO	1.242,86	-4,09	-55,36	T-NOTE 10Y	3,560	-2,34	-12,80
TRIGO	494,00	9,50	-38,75	T-NOTE 2Y	2,969	-2,35	-3,90
LICENÇA C02	16,01	-0,08	0,70	GILT 10Y	1,492	-0,67	-10,20


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1643	-0,13%	-1,03%	1,1723	1,1814	1,2001
EUR/GBP	0,88488	-0,25%	-0,31%	0,8875	0,8904	0,8966
EUR/JPY	131,04	0,07%	-0,77%	131,04	131,04	131,04
EUR/CHF	1,1700	-0,01%	-0,78%	1,1689	1,1676	1,1654
EUR/BRL	4,5081	0,53%	-2,67%	4,5806	4,6547	4,8190
EUR/PLN	4,3137	0,08%	-0,97%	4,3371	4,3603	4,4075

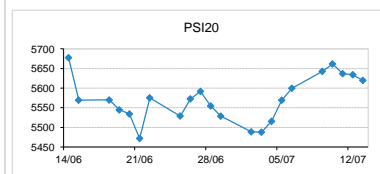

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1643	0,8849	131,04	1,1700	10,3898	7,4544	1,5367	1,57462	4,5081	9,4859
USD	0,8572	-	0,7575	112,415	1,0035	8,9023	6,3896	1,3165	1,3496	3,8656	8,1321

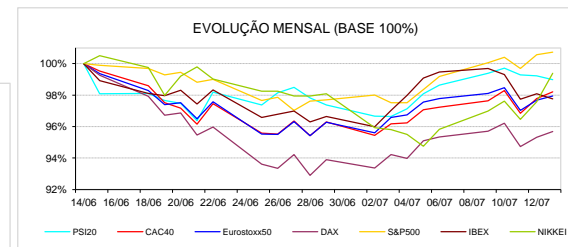
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	9,100	-0,33	75,98
BCP	0,259	0,46	-4,63
CORT. AMORIM	11,3200	-0,53	9,90
CTT	2,9060	0,55	-17,14
EDP	3,460	-1,17	19,93
EDP R	8,930	-0,78	28,18
GALP	16,880	0,15	10,15
IBERSOL	12,200	0,41	0,41
J MARTINS	12,670	0,72	-21,77
MOTA ENGIL	2,995	-0,33	-18,24
NAVIGATOR	5,075	-1,07	20,26
NOS	4,902	-0,57	-10,56
NOVABASE	2,670	-0,37	-12,43
PHAROL	0,244	-2,20	-2,40
REN	2,464	-0,16	-0,61
SEMAPA	22,850	0,00	28,41
SONAE CAP.	0,923	-0,97	4,06
SONAE SGPS	1,018	0,00	-9,59

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
J MARTINS	0,72
CTT	0,55
BCP	0,46
IBERSOL	0,41
GALP	0,15
EDP R	-0,78
SONAE CAP.	-0,97
NAVIGATOR	-1,07
EDP	-1,17
PHAROL	-2,20



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.619,49	-0,26%	4,29%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.429,20	0,43%	2,20%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.454,54	0,26%	-1,42%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.540,73	0,38%	-2,92%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.803,02	0,17%	4,84%	2.872,87	2.417,35
IBEX 35	9.734,80	-0,33%	-3,08%	10.758,20	9.327,60
NIKKEI 225	22.597,35	1,85%	-0,74%	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.