

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

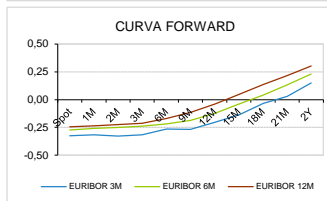
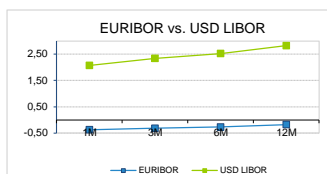
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

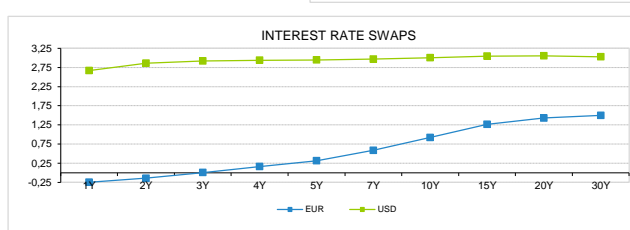
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,0711	-1	-2	0,7211	-0,7746
3M	-0,3190	0	0	3M	2,3414	0	1	0,8064	-0,7256
6M	-0,2680	0	0	6M	2,5224	0	1	0,9065	-0,6490
12M	-0,1760	0	1	12M	2,8243	0	5	1,0515	-0,5156

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2440	0	1	-0,0402	0,6332	1,1780
2Y	-0,1420	0	3	0,1316	0,7762	1,2930
3Y	0,0080	0	4	0,2970	0,9094	1,3960
4Y	0,1650	-1	4	0,4520	1,0324	1,4938
5Y	0,3140	-1	5	0,5955	1,1445	1,5710
7Y	0,5850	-1	5	0,8495	1,3359	1,6860
10Y	0,9190	-1	5	1,1470	1,5320	1,8161
15Y	1,2660	-1	4	1,4303	1,6943	1,8847
20Y	1,4290	-1	3	1,5549	1,7402	1,8559
30Y	1,4980	-1	3	1,5883	1,7098	1,7830

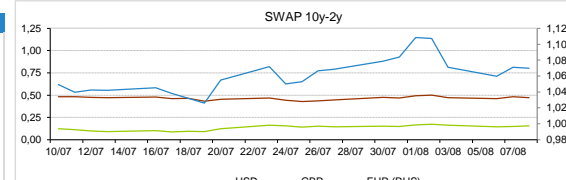
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6700	0	5	3,0671	3,0118	3,0030
2Y	2,8600	-1	6	3,0666	3,0149	3,0100
3Y	2,9160	-1	6	3,0522	2,9855	3,0578
4Y	2,9370	-2	6	3,0190	3,0040	3,0741
5Y	2,9470	-2	7	3,0150	3,0150	3,0923
7Y	2,9670	-2	9	3,0240	3,0440	3,1159
10Y	3,0030	-3	10	3,0780	3,0710	3,1000
15Y	3,0450	-2	12	3,0750	3,1064	3,0940
20Y	3,0520	-2	13	3,0720	3,0690	3,0700
30Y	3,0280	-2	14	3,0350	3,0270	3,0190

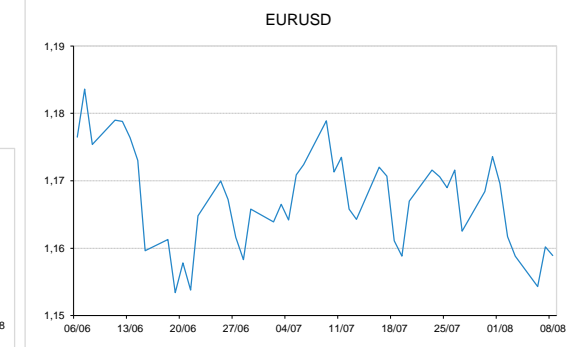
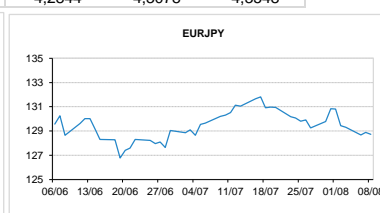


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	72,30	-2,35	-4,61	OT 2Y	-0,157	0,00	-8,40
JETFUEL	688,17	-16,26	-28,05	OT 5Y	0,583	0,02	-3,50
DIESEL	649,67	-15,51	-20,05	OT 10Y	1,771	0,02	-1,10
COBRE	6.156,50	42,00	-107,00	BUND 10Y	-0,164	-1,41	3,00
ZINCO	2.613,00	30,75	-123,00	SCHATZ 2Y	0,021	-1,61	4,20
OURO	1.210,07	-1,66	-45,35	T-NOTE 10Y	3,651	-0,67	6,40
TRIGO	590,50	0,50	60,50	T-NOTE 2Y	3,031	-0,78	6,60
LICENÇA C02	17,41	-0,10	1,71	GILT 10Y	1,524	-1,92	2,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1589	-0,11%	-1,70%	1,1673	1,1764	1,1956
EUR/GBP	0,90085	-0,67%	-1,93%	0,9037	0,9065	0,9129
EUR/JPY	128,72	0,12%	1,16%	128,72	128,72	128,72
EUR/CHF	1,1533	0,03%	1,05%	1,1521	1,1510	1,1487
EUR/BRL	4,3433	0,21%	4,62%	4,4117	4,4821	4,6443
EUR/PLN	4,2607	-0,06%	1,27%	4,2844	4,3078	4,3548



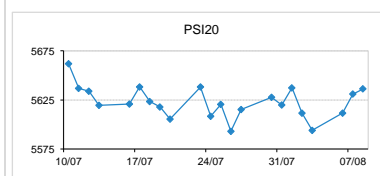
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1589	0,9009	128,72	1,1533	10,3943	7,4544	1,5152	1,56323	4,3433	9,5487
USD	0,8619	-	0,7764	110,965	0,9945	8,9547	6,4248	1,3059	1,3476	3,7474	8,2219

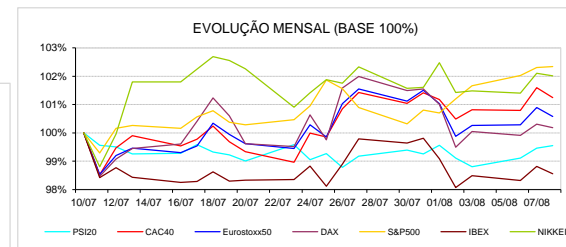
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,880	-0,11	71,73
BCP	0,262	-0,30	-3,79
CORT. AMORIM	10,6400	0,00	3,30
CTT	3,1800	3,18	-9,32
EDP	3,462	-0,92	20,00
EDP R	8,770	0,00	25,88
GALP	17,895	-0,11	16,77
IBERSOL	9,620	1,05	-4,99
J MARTINS	13,125	1,23	-18,96
MOTA ENIGL	2,800	-0,71	-23,56
NAVIGATOR	5,030	0,88	19,19
NOS	4,932	0,41	-10,02
NOVABASE	2,670	-0,74	-12,43
PHAROL	0,229	-0,22	-8,40
REN	2,494	0,00	0,61
SEMAPA	20,150	-1,23	13,23
SONAE CAP.	0,889	-0,22	0,23
SONAE SGPS	0,994	0,10	-11,77

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	3,18
J MARTINS	1,23
IBERSOL	1,05
NAVIGATOR	0,88
NOS	0,41
BCP	-0,30
MOTA ENIGL	-0,71
NOVABASE	-0,74
EDP	-0,92
SEMAPA	-1,23



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.636,26	0,09%	4,60%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.501,90	-0,35%	3,56%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.493,60	-0,31%	-0,30%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.633,54	-0,12%	-2,20%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.859,11	0,02%	6,94%	2.872,87	2.417,35
IBEX 35	9.747,10	-0,26%	-2,96%	10.758,20	9.327,60
NIKKEI 225	22.644,31	-0,08%	-0,53%	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.