

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

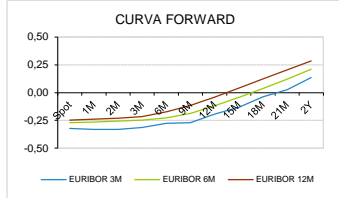
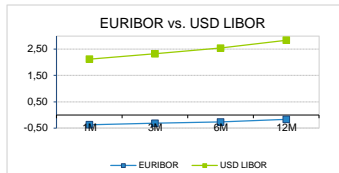
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

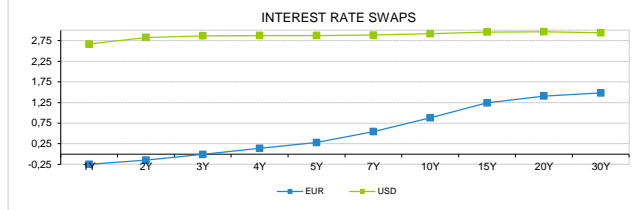
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,1203	1	4	0,7240	-0,7806
3M	-0,3190	0	0	3M	2,3228	1	-2	0,7994	-0,7284
6M	-0,2690	0	0	6M	2,5390	0	1	0,8933	-0,6500
12M	-0,1670	0	1	12M	2,8429	0	2	1,0396	-0,5180

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,2483	0	0	-0,0407	0,6100	1,1340	
2Y	-0,1490	0	-1	0,1230	0,7480	1,2460	
3Y	-0,0100	0	-2	0,2866	0,8760	1,3485	
4Y	0,1380	0	-4	0,4358	0,9950	1,4410	
5Y	0,2800	1	-5	0,5741	1,1050	1,5223	
7Y	0,5450	1	-6	0,8209	1,2970	1,6540	
10Y	0,8790	1	-6	1,1168	1,4982	1,7755	
15Y	1,2400	1	-5	1,4033	1,6644	1,8450	
20Y	1,4070	1	-5	1,5274	1,7093	1,8240	
30Y	1,4800	1	-4	1,5592	1,6766	1,7465	

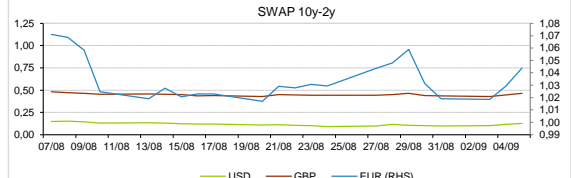
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



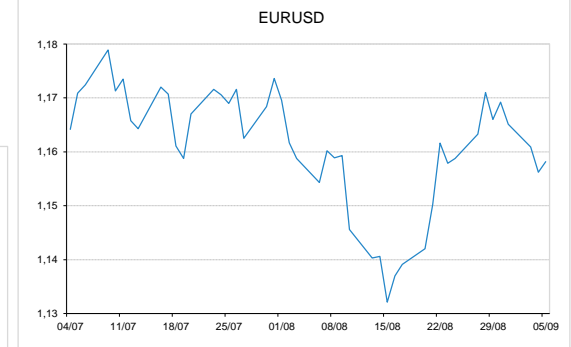
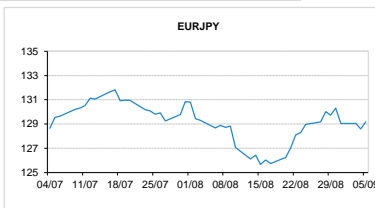
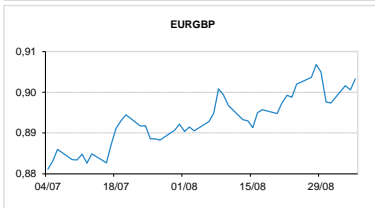
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS			
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	2,6660	-1	-1	3,0018	2,9397	2,9215	
2Y	2,8280	-2	-5	2,9860	2,9130	2,9460	
3Y	2,8660	-3	-8	2,9450	2,9065	2,9640	
4Y	2,8740	-3	-9	2,9340	2,9190	2,9870	
5Y	2,8740	-3	-10	2,9310	2,9680	3,0359	
7Y	2,8830	-3	-11	2,9430	2,9710	3,0380	
10Y	2,9160	-3	-12	3,0139	3,0135	3,0540	
15Y	2,9560	-3	-11	3,0422	3,0554	3,0450	
20Y	2,9640	-3	-10	3,0439	3,0205	3,0290	
30Y	2,9400	-3	-10	2,9930	3,0054	3,0025	



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	77,33	-0,84	3,80	OT 2Y	-0,122	0,00	4,60
JETFUEL	728,83	-12,60	34,25	OT 5Y	0,665	0,00	10,50
DIESEL	692,83	-11,85	36,75	OT 10Y	1,874	0,00	12,30
COBRE	5.840,00	-152,00	-391,00	BUND 10Y	-0,003	2,33	-1,40
ZINCO	2.428,00	-44,00	-219,00	SCHATZ 2Y	0,062	2,30	0,70
OURO	1.197,00	3,64	-18,89	T-NOTE 10Y	3,602	-0,67	-4,70
TRIGO	524,75	-6,75	-55,00	T-NOTE 2Y	3,063	-1,57	-3,90
LICENÇA C02	20,39	0,21	2,71	GILT 10Y	1,591	1,93	-1,00


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1582	0,17%	0,34%	1,1664	1,1756	1,1953
EUR/GBP	0,90328	-0,30%	-1,16%	0,9060	0,9090	0,9155
EUR/JPY	129,17	-0,44%	-0,38%	129,17	129,17	129,17
EUR/CHF	1,1294	-0,08%	2,02%	1,1283	1,1271	1,1248
EUR/BRL	4,8321	-0,26%	-10,68%	4,9100	4,9902	5,1850
EUR/PLN	4,3339	-0,60%	-1,80%	4,3560	4,3789	4,4286

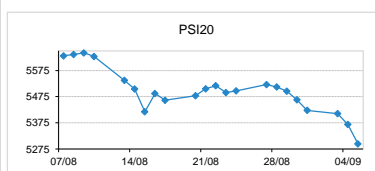

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1582	0,9033	129,17	1,1294	10,5403	7,4558	1,5325	1,61648	4,8321	9,7732
USD	0,8602	-	0,7718	111,585	0,9716	9,0666	6,4132	1,3187	1,3905	4,1550	8,4044

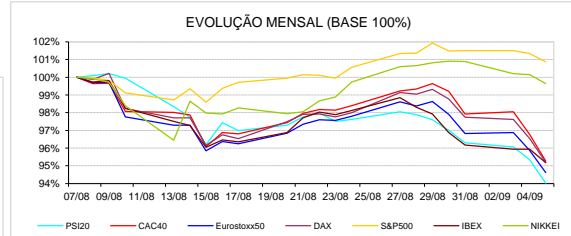
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,740	-1,90	49,68
BCP	0,250	0,04	-7,98
CORT. AMORIM	10,9600	-2,32	6,41
CTT	3,3440	-0,71	-4,65
EDP	3,305	-0,75	14,56
EDP R	8,350	-1,12	19,85
GALP	16,835	-3,66	9,85
IBERSOL	9,160	-0,65	-9,53
J MARTINS	12,435	-2,81	-23,22
MOTA ENGIL	2,325	-4,32	-36,53
NAVIGATOR	4,172	-0,95	-1,14
NOS	4,856	-0,41	-11,40
NOVABASE	2,690	-1,10	-11,77
PHAROL	0,187	-1,48	-25,20
REN	2,424	0,00	-2,22
SEMAPA	17,700	1,14	-0,53
SONAE CAP.	0,800	-5,66	-9,81
SONAE SGPS	0,911	-0,98	-19,14

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SEMAPA	1,14
BCP	0,04
CORT. AMORIM	-2,32
J MARTINS	-2,81
GALP	-3,66
MOTA ENGIL	-4,32
SONAE CAP.	-5,66



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.294,33	-1,39%	-1,74%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.260,22	-1,54%	-0,99%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.315,62	-1,30%	-5,38%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.040,46	-1,39%	-6,79%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.883,44	-0,46%	7,85%	2.916,50	2.446,55
IBEX 35	9.301,30	-0,80%	-7,39%	10.643,40	9.301,30
NIKKEI 225	22.580,83	-0,51%	-0,81%	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.