

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

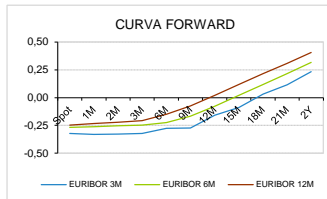
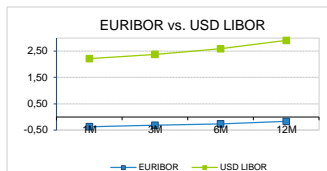
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

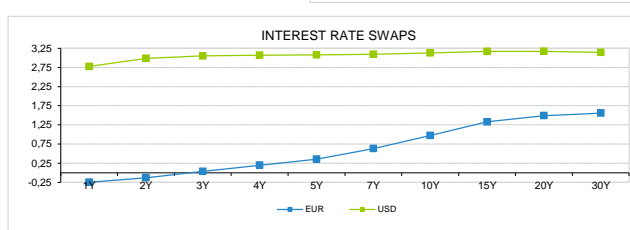
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3720	0	0	1M	2,2158	0	15	0,7256	-0,7788
3M	-0,3190	0	0	3M	2,3726	1	6	0,8040	-0,7308
6M	-0,2670	0	0	6M	2,5920	1	8	0,9036	-0,6516
12M	-0,1670	0	0	12M	2,9083	1	10	1,0641	-0,5186

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2464	0	0	0,0212	0,7603	1,2823
2Y	-0,1280	0	3	0,2116	0,9039	1,3840
3Y	0,0350	0	6	0,3931	1,0000	1,4815
4Y	0,2000	0	8	0,5546	1,1410	1,5695
5Y	0,3560	0	9	0,6960	1,2460	1,6470
7Y	0,6340	-1	10	0,9435	1,4270	1,7635
10Y	0,9720	-1	11	1,2305	1,6123	1,8730
15Y	1,3280	-1	10	1,5014	1,7616	1,9315
20Y	1,4930	-1	11	1,6171	1,8000	1,9052
30Y	1,5610	-1	10	1,6383	1,7568	1,8209

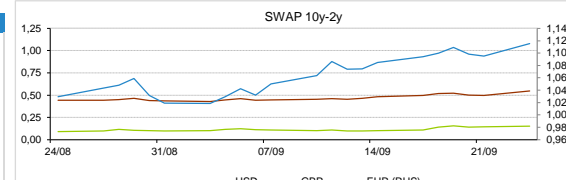
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7740	0	15	3,1953	3,1080	3,1280
2Y	2,9860	0	19	3,1909	3,1328	3,1505
3Y	3,0500	0	20	3,1742	3,0975	3,1659
4Y	3,0690	0	21	3,1305	3,1419	3,1831
5Y	3,0770	0	21	3,1230	3,1135	3,1962
7Y	3,0940	0	22	3,1255	3,1490	3,1870
10Y	3,1290	-1	21	3,1670	3,1715	3,2313
15Y	3,1660	-1	21	3,2082	3,2111	3,1760
20Y	3,1720	-1	21	3,2016	3,1950	3,1660
30Y	3,1430	-1	20	3,1641	3,1502	3,1416

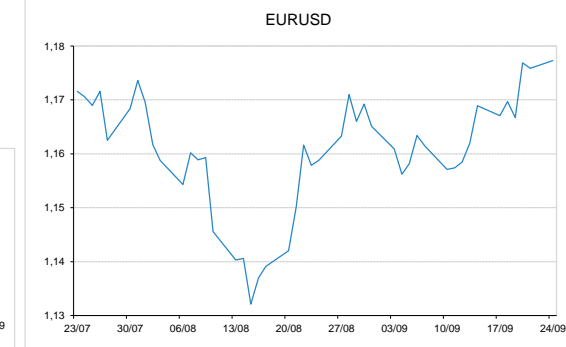
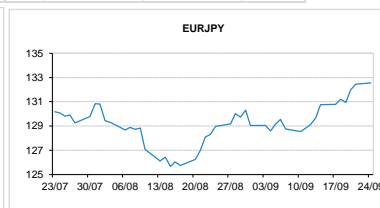
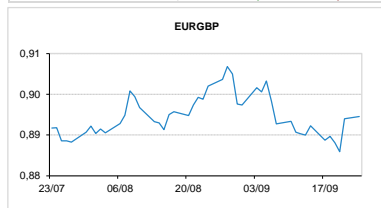


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	81,19	2,39	5,06	OT 2Y	-0,089	0,00	10,50
JETFUEL	745,25	19,75	27,25	OT 5Y	0,744	0,04	16,20
DIESEL	707,75	19,25	24,25	OT 10Y	1,900	0,03	10,10
COBRE	6.337,50	281,00	318,00	BUND 10Y	0,129	5,39	16,90
ZINCO	2.502,75	48,25	72,25	SCHATZ 2Y	0,115	2,76	8,30
OURO	1.201,03	3,70	-4,53	T-NOTE 10Y	3,756	1,19	20,70
TRIGO	525,00	3,25	-11,50	T-NOTE 2Y	3,212	0,39	18,10
LICENÇA C02	22,46	0,33	1,77	GILT 10Y	1,745	5,78	17,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1773	0,12%	1,60%	1,1858	1,1955	1,2160
EUR/GBP	0,89458	-0,06%	0,83%	0,8974	0,9004	0,9071
EUR/JPY	132,56	-0,09%	-2,71%	132,56	132,56	132,56
EUR/CHF	1,1326	-0,58%	0,87%	1,1314	1,1302	1,1279
EUR/BRL	4,7861	-0,55%	-0,29%	4,8599	4,9434	5,1382
EUR/PLN	4,2974	0,22%	-0,47%	4,3197	4,3428	4,3919



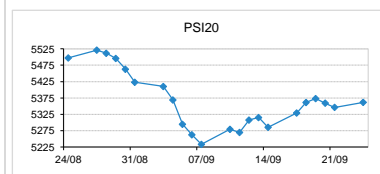
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1773	0,8946	132,56	1,1326	10,3560	7,4596	1,5223	1,62081	4,7861	9,5744
USD	0,8483	-	0,761	112,505	0,9601	8,7830	6,3279	1,2930	1,3766	4,0563	8,1283

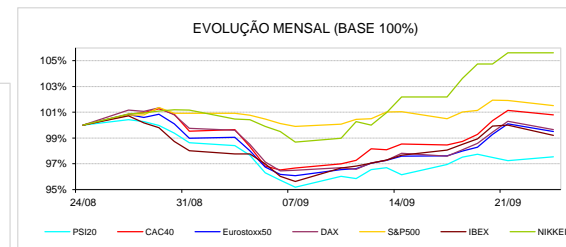
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	8,300	1,72	60,51
BCP	0,253	0,92	-6,88
CORT. AMORIM	11,420	-1,89	10,87
CTT	3,354	-0,53	-4,36
EDP	3,265	1,27	13,17
EDP R	8,705	-0,17	24,95
GALP	16,780	2,16	9,49
IBERSOL	9,320	1,08	-7,95
J MARTINS	12,690	-1,44	-21,64
MOTA ENGL	2,075	-2,12	-43,35
NAVIGATOR	4,258	-1,39	0,90
NOS	5,150	0,29	-6,04
NOVABASE	2,670	-0,74	-12,43
PHAROL	0,182	0,66	-27,20
REN	2,424	0,08	-2,22
SEMAPA	17,320	1,29	-2,67
SONAE CAP.	0,753	-1,70	-15,11
SONAE SGPS	0,896	-0,33	-20,43

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
GALP	2,16
ALTRI	1,72
SEMAPA	1,29
EDP	1,27
IBERSOL	1,08
NAVIGATOR	-1,39
J MARTINS	-1,44
SONAE CAP.	-1,70
CORT. AMORIM	-1,89
MOTA ENGL	-2,12



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.361,44	0,29%	-0,50%	5.801,45	5.208,33
CAC40	5.476,17	-0,33%	3,08%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.410,44	-0,59%	-2,67%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.350,82	-0,64%	-4,39%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.918,12	-0,39%	9,15%	2.940,91	2.488,03
IBEX 35	9.512,80	-0,81%	-5,29%	10.643,40	9.111,10
NIKKEI 225	23.869,93	0,82%	4,85%	24.129,34	20.213,66



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.