

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

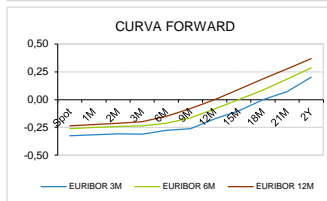
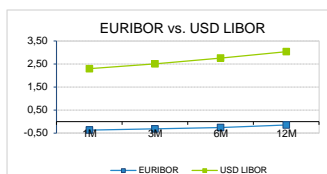
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

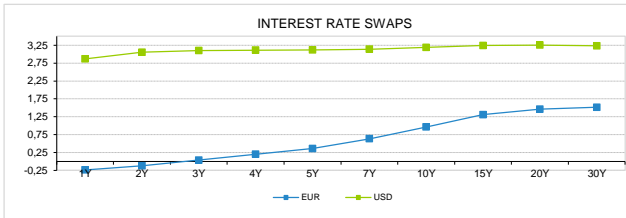
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,2941	1	8	0,7204	-0,7834
3M	-0,3170	0	0	3M	2,5080	2	13	0,8081	-0,7404
6M	-0,2590	0	1	6M	2,7598	1	17	0,9083	-0,6660
12M	-0,1470	0	2	12M	3,0394	1	13	1,0566	-0,5318

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,2369	0	1	-0,0007	0,7160	1,2545	
2Y	-0,1220	-1	0	0,1842	0,8555	1,3540	
3Y	0,0370	-2	0	0,3610	0,9895	1,4510	
4Y	0,2030	-2	0	0,5185	1,1030	1,5360	
5Y	0,3580	-2	0	0,6620	1,2090	1,6130	
7Y	0,6340	-3	0	0,9110	1,3910	1,7350	
10Y	0,9630	-3	-1	1,1990	1,5814	1,8440	
15Y	1,3070	-2	-3	1,4716	1,7297	1,8990	
20Y	1,4600	-2	-4	1,5853	1,7642	1,8670	
30Y	1,5140	-2	-5	1,6006	1,7160	1,7780	

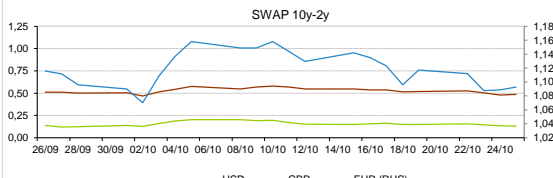
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



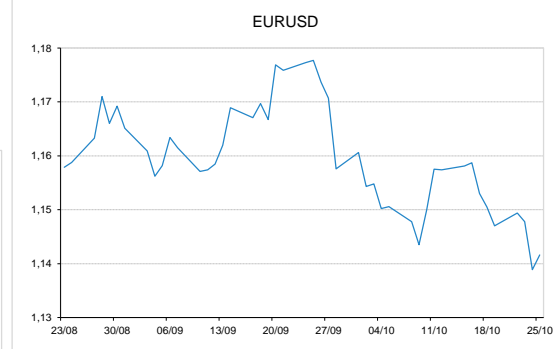
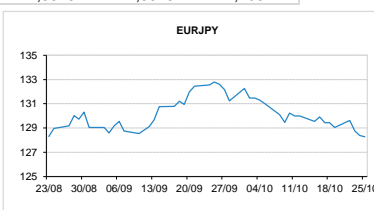
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8670	-3	9	3,2237	3,1539	3,1530
2Y	3,0540	-5	7	3,1855	3,1320	3,2148
3Y	3,1010	-7	5	3,1745	3,1240	3,1995
4Y	3,1120	-7	4	3,1796	3,1794	3,2633
5Y	3,1160	-8	4	3,1500	3,1630	3,2893
7Y	3,1400	-7	5	3,2028	3,2060	3,2900
10Y	3,1880	-7	6	3,2335	3,2580	3,3380
15Y	3,2420	-7	8	3,2625	3,2815	3,3010
20Y	3,2540	-6	8	3,2917	3,2725	3,2815
30Y	3,2330	-6	9	3,2370	3,2320	3,2325



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	76,59	0,42	-4,67	OT 2Y	-0,125	0,00	-3,20
JETFUEL	740,75	-8,50	-4,50	OT 5Y	0,742	-0,06	0,60
DIESEL	700,50	-7,75	-7,25	OT 10Y	1,937	-0,04	4,40
COBRE	6.178,00	-17,00	-174,00	BUND 10Y	-0,006	0,75	-16,70
ZINCO	2.709,00	-8,50	136,50	SCHATZ 2Y	0,016	1,15	-11,30
OURO	1.229,79	1,92	28,72	T-NOTE 10Y	3,758	0,85	-1,00
TRIGO	492,50	-7,00	-28,25	T-NOTE 2Y	3,220	0,79	-0,80
LICENÇA C02	19,19	-0,42	-2,06	GILT 10Y	1,576	-0,87	-18,40


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1416	0,24%	-3,07%	1,1511	1,1603	1,1804
EUR/GBP	0,88533	-0,34%	1,01%	0,8884	0,8914	0,8981
EUR/JPY	128,27	0,08%	3,52%	128,27	128,27	128,27
EUR/CHF	1,1387	-0,16%	-0,33%	1,1374	1,1363	1,1339
EUR/BRL	4,2023	1,16%	14,07%	4,2665	4,3311	4,5009
EUR/PLN	4,3076	-0,05%	-0,36%	4,3315	4,3543	4,4037

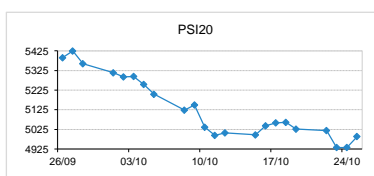

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1416	0,8853	128,27	1,1387	10,3595	7,4608	1,4870	1,60563	4,2023	9,4826
USD	0,8788	-	0,7804	112,545	1,0014	9,1148	6,5562	1,3094	1,4127	3,6993	8,3284

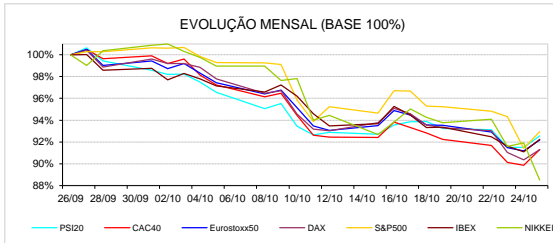
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,560	8,31	46,20
BCP	0,223	2,38	-17,87
CORT. AMORIM	9,970	0,50	-3,20
CTT	3,206	1,46	-8,58
EDP	3,072	-0,29	6,48
EDP R	8,000	0,13	14,83
GALP	15,195	0,23	-0,85
IBERSOL	8,580	0,23	-15,26
J MARTINS	11,735	0,30	-27,54
MOTA ENIGL	1,718	2,14	-53,10
NAVIGATOR	4,234	4,75	0,33
NOS	5,005	0,14	-8,68
NOVABASE	2,480	0,81	-18,66
PHAROL	0,140	0,00	-44,08
REN	2,340	0,26	-5,61
SEMAPA	16,340	3,94	-8,18
SONAE CAP.	0,750	0,67	-15,45
SONAE SGPS	0,870	0,40	-22,78

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	8,31
NAVIGATOR	4,75
SEMAPA	3,94
BCP	2,38
MOTA ENIGL	2,14
EDP	-0,29



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.988,15	1,13%	-7,43%	5.801,45	4.901,69
CAC40	5.032,30	1,60%	-5,28%	5.657,44	4.925,56
ESTX 50 PR	3.164,40	1,09%	-9,69%	3.708,82	3.107,88
XTRA DAX	11.307,12	1,03%	-12,47%	13.596,89	11.078,37
S&P 500	2.701,14	1,69%	1,02%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.785,20	1,24%	-12,53%	10.643,40	8.639,70
NIKKEI 225	21.268,73	-3,72%	-6,57%	24.448,07	20.347,49



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.