

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

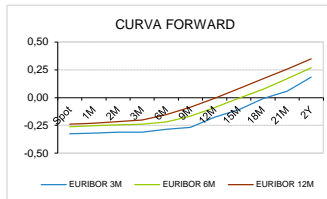
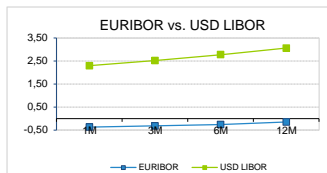
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

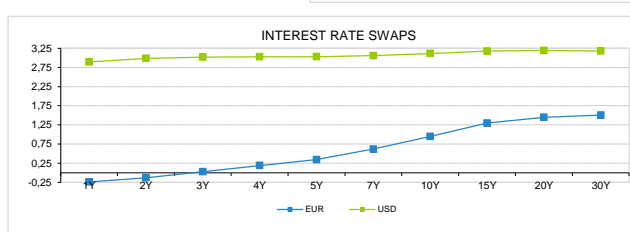
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,2967	0	5	0,7248	-0,7816
3M	-0,3180	0	0	3M	2,5204	1	13	0,8102	-0,7412
6M	-0,2590	0	1	6M	2,7768	0	18	0,9114	-0,6638
12M	-0,1490	0	1	12M	3,0568	1	14	1,0534	-0,5322

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2390	0	0	-0,0085	0,6780	1,2147
2Y	-0,1260	-1	-2	0,1695	0,8168	1,3248
3Y	0,0290	-1	-5	0,3390	0,9483	1,4225
4Y	0,1910	-2	-6	0,4900	1,0682	1,5100
5Y	0,3430	-2	-7	0,6338	1,1765	1,5870
7Y	0,6180	-2	-8	0,8827	1,3595	1,7110
10Y	0,9480	-2	-8	1,1727	1,5513	1,8225
15Y	1,2960	-2	-7	1,4461	1,7036	1,8800
20Y	1,4500	-2	-7	1,5621	1,7415	1,8505
30Y	1,5050	-2	-8	1,5816	1,6966	1,7610

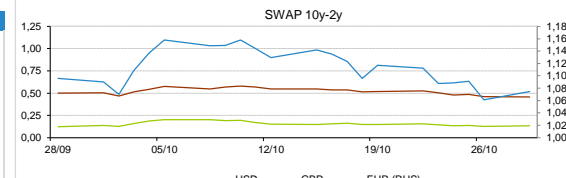
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



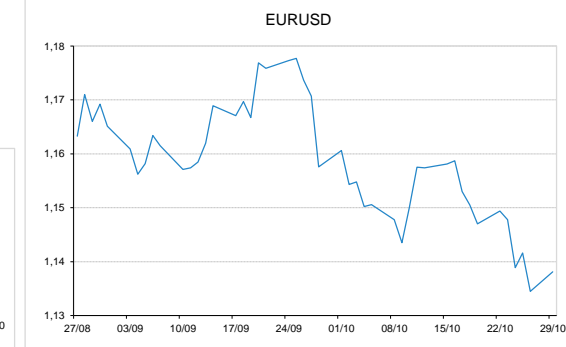
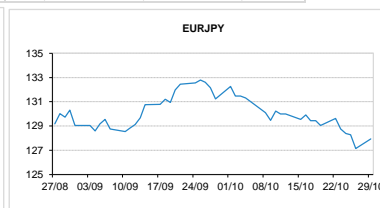
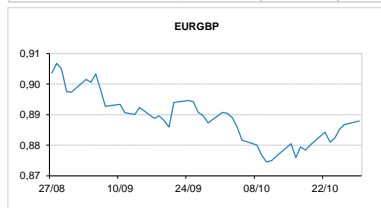
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8950	2	10	3,1766	3,1142	3,1205
2Y	2,9890	-8	-1	3,1310	3,0950	3,1515
3Y	3,0210	-9	-5	3,1100	3,1010	3,1630
4Y	3,0290	-9	-6	3,1220	3,1210	3,2080
5Y	3,0310	-9	-7	3,1045	3,1255	3,2606
7Y	3,0580	-9	-6	3,1380	3,1720	3,2650
10Y	3,1140	-8	-3	3,2040	3,2410	3,2950
15Y	3,1770	-8	0	3,2215	3,2330	3,2910
20Y	3,1940	-7	1	3,2290	3,2360	3,2495
30Y	3,1780	-7	2	3,2425	3,2040	3,2429



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	77,49	-0,13	-5,24	OT 2Y	-0,137	-0,01	-2,90
JETFUEL	753,25	-3,00	-14,75	OT 5Y	0,691	-0,03	-3,50
DIESEL	716,75	-1,75	-11,50	OT 10Y	1,874	-0,03	0,60
COBRE	6.182,00	-66,00	-122,00	BUND 10Y	-0,023	4,27	-17,00
ZINCO	2.699,00	16,00	143,25	SCHATZ 2Y	0,009	2,29	-12,20
OURO	1.226,01	-7,93	33,49	T-NOTE 10Y	3,729	2,38	-0,70
TRIGO	506,50	1,25	-2,50	T-NOTE 2Y	3,188	2,36	-3,20
LICENÇA C02	16,68	-1,60	-4,53	GILT 10Y	1,533	2,88	-19,50


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1381	0,32%	-1,94%	1,1478	1,1569	1,1771
EUR/GBP	0,88788	-0,12%	0,33%	0,8910	0,8941	0,9007
EUR/JPY	127,92	-0,62%	3,38%	127,92	127,92	127,92
EUR/CHF	1,1401	-0,23%	-0,16%	1,1389	1,1377	1,1355
EUR/BRL	4,2091	-1,30%	10,59%	4,2765	4,3424	4,4999
EUR/PLN	4,3273	-0,38%	-1,01%	4,3516	4,3744	4,4241

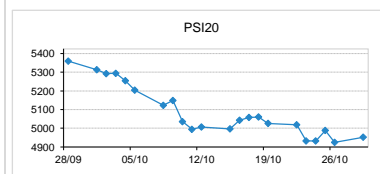

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1381	0,8879	127,92	1,1401	10,4037	7,4619	1,4938	1,6106	4,2091	9,5405
USD	0,8785	-	0,7804	112,485	1,0001	9,1222	6,5546	1,3124	1,4125	3,6389	8,3670

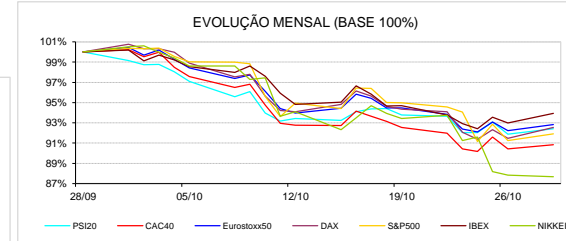
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,630	0,93	47,55
BCP	0,220	1,43	-19,04
CORT. AMORIM	9,730	-0,82	-5,53
CTT	3,226	0,81	-8,01
EDP	3,088	1,21	7,04
EDP R	7,870	-1,38	12,96
GALP	14,970	-0,20	-2,32
IBERSOL	8,520	-0,47	-15,85
J MARTINS	11,410	-0,39	-29,55
MOTA ENGIL	1,722	3,24	-52,99
NAVIGATOR	4,328	2,51	2,56
NOS	4,940	1,23	-9,87
NOVABASE	2,480	0,81	-18,66
PHAROL	0,145	4,62	-42,00
REN	2,340	0,17	-5,61
SEMAPA	16,460	1,11	-7,50
SONAE CAP.	0,733	-1,35	-17,36
SONAE SGPS	0,859	0,47	-23,71

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	4,62
MOTA ENGIL	3,24
NAVIGATOR	2,51
BCP	1,43
NOS	1,23
J MARTINS	-0,39
IBERSOL	-0,47
CORT. AMORIM	-0,82
SONAE CAP.	-1,35
EDP R	-1,38



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.952,31	0,56%	-8,09%	5.801,45	4.893,44
CAC40	4.989,35	0,44%	-6,08%	5.657,44	4.896,80
ESTX 50 PR	3.154,93	0,64%	-9,96%	3.708,82	3.090,85
XTRA DAX	11.335,48	1,20%	-12,25%	13.596,89	11.051,04
S&P 500	2.678,72	0,73%	0,16%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.821,20	1,04%	-12,17%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	21.149,80	-0,16%	-7,09%	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.