

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

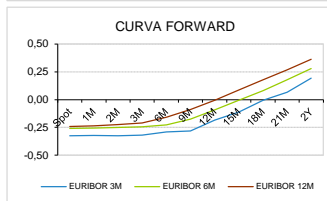
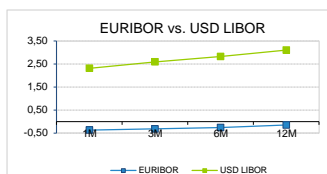
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

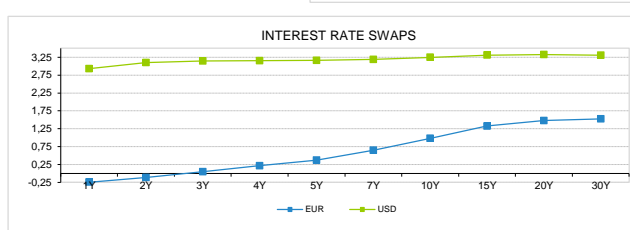
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,3179	0	4	0,7261
3M	-0,3180	0	0	3M	2,5924	1	18	0,8281
6M	-0,2570	0	1	6M	2,8289	1	22	0,9608
12M	-0,1480	0	1	12M	3,1049	1	18	1,1178
								-0,5310

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2420	0	0	-0,0051	0,7028	1,2491
2Y	-0,1140	0	0	0,1772	0,8450	1,3588
3Y	0,0500	0	0	0,3508	0,9784	1,4586
4Y	0,2160	0	0	0,5082	1,0996	1,5479
5Y	0,3720	0	0	0,6535	1,2087	1,6180
7Y	0,6490	0	0	0,9068	1,3900	1,7360
10Y	0,9810	0	1	1,1957	1,5782	1,8440
15Y	1,3250	1	1	1,4664	1,7238	1,8950
20Y	1,4780	1	0	1,5773	1,7562	1,8600
30Y	1,5270	1	-2	1,5901	1,7050	1,7670

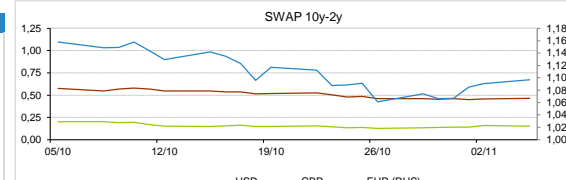
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



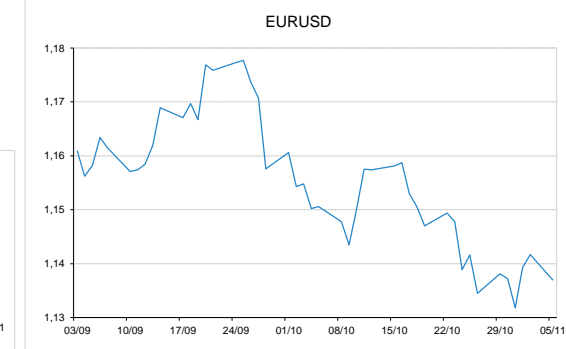
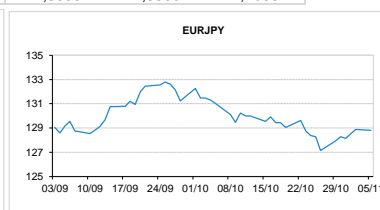
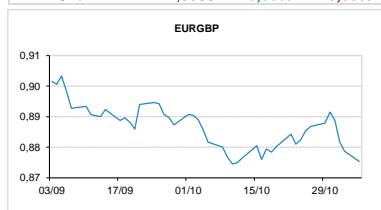
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,9290	1	14	3,2579	3,1660	3,2165
2Y	3,0980	2	12	3,2330	3,1897	3,2470
3Y	3,1420	2	11	3,2125	3,2082	3,2685
4Y	3,1540	3	11	3,1995	3,2294	3,3295
5Y	3,1610	3	11	3,2248	3,2260	3,3529
7Y	3,1900	3	12	3,2310	3,2770	3,3595
10Y	3,2480	3	15	3,3057	3,3480	3,4061
15Y	3,3090	3	17	3,3474	3,3470	3,3740
20Y	3,3240	3	17	3,3527	3,3370	3,3540
30Y	3,3070	3	19	3,3250	3,3251	3,3075



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	73,38	0,55	-10,41	OT 2Y	-0,140	0,00	-4,40
JETFUEL	719,96	3,42	-71,38	OT 5Y	0,694	0,00	-6,30
DIESEL	679,46	3,92	-67,38	OT 10Y	1,884	0,00	-2,90
COBRE	6.305,00	193,00	3,00	BUND 10Y	0,017	-1,13	-13,10
ZINCO	2.601,50	8,75	-90,50	SCHATZ 2Y	0,023	0,69	-9,00
OURO	1.229,76	-2,44	28,35	T-NOTE 10Y	3,794	-1,88	-3,90
TRIGO	504,50	-4,25	-16,50	T-NOTE 2Y	3,255	-1,18	-1,60
LICENÇA C02	17,18	0,10	-4,98	GILT 10Y	1,630	0,49	-15,70


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,137	-0,41%	-1,18%	1,1466	1,1557	1,1761
EUR/GBP	0,87535	0,38%	0,72%	0,8785	0,8816	0,8886
EUR/JPY	128,81	0,06%	1,72%	128,81	128,81	128,81
EUR/CHF	1,1454	-0,26%	-0,17%	1,1442	1,1431	1,1406
EUR/BRL	4,2339	-0,30%	4,43%	4,2974	4,3609	4,5173
EUR/PLN	4,3086	0,00%	-0,08%	4,3333	4,3560	4,4053

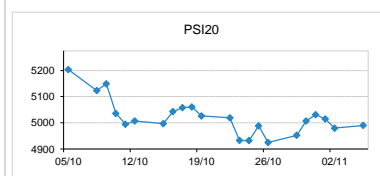

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1370	0,8754	128,81	1,1454	10,3382	7,4592	1,4934	1,58361	4,2339	9,5224
USD	0,8773	-	0,768	113,21	1,0050	9,0660	6,5442	1,3088	1,3874	3,6995	8,3505

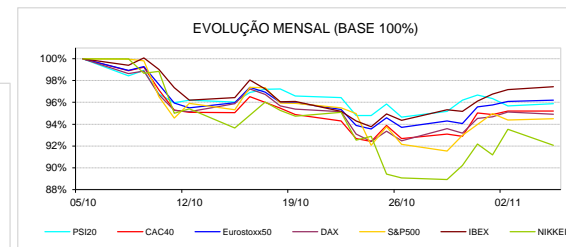
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,340	-1,48	41,95
BCP	0,243	0,21	-10,55
CORT. AMORIM	9,800	0,51	-4,85
CTT	3,338	-0,18	-4,82
EDP	3,096	0,52	7,31
EDP R	7,890	0,51	13,25
GALP	15,015	1,25	-2,02
IBERSOL	8,460	-0,24	-16,44
J MARTINS	10,800	-0,23	-33,31
MOTA ENGIL	1,728	-2,92	-52,83
NAVIGATOR	4,122	-1,15	-2,33
NOS	5,120	1,59	-6,59
NOVABASE	2,480	0,00	-18,66
PHAROL	0,153	-0,26	-38,96
REN	2,370	0,00	-4,40
SEMAPA	15,960	0,00	-10,31
SONAE CAP.	0,761	0,00	-14,21
SONAE SGPS	0,873	-1,97	-22,51

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOS	1,59
GALP	1,25
EDP	0,52
CORT. AMORIM	0,51
EDP R	0,51
PHAROL	-0,26
NAVIGATOR	-1,15
ALTRI	-1,48
SONAE SGPS	-1,97
MOTA ENGIL	-2,92



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.990,12	0,21%	-7,39%	5.801,45	4.893,44
CAC40	5.102,12	0,00%	-3,96%	5.657,44	4.896,80
ESTX 50 PR	3.218,43	0,13%	-8,15%	3.695,32	3.090,85
XTRA DAX	11.495,08	-0,21%	-11,01%	13.596,89	11.051,04
S&P 500	2.726,41	0,15%	2,00%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	9.015,90	0,25%	-10,24%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	21.898,99	-1,55%	-3,80%	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.