

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

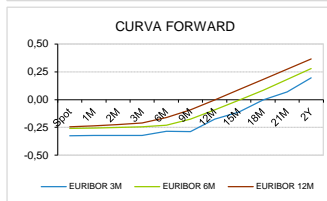
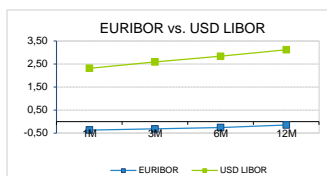
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

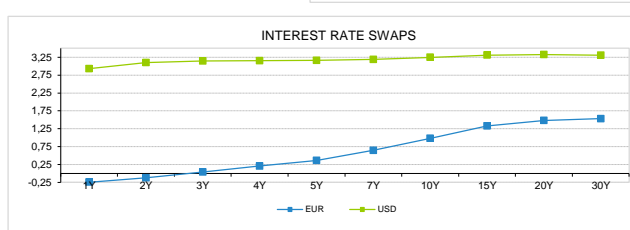
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,3160	0	4	0,7271	-0,7852
3M	-0,3170	0	0	3M	2,5893	0	18	0,8385	-0,7466
6M	-0,2580	0	1	6M	2,8358	1	21	0,9668	-0,6634
12M	-0,1490	0	1	12M	3,1169	1	16	1,1221	-0,5306

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2433	0	0	-0,0039	0,7110	1,2584
2Y	-0,1240	-1	-3	0,1793	0,8576	1,3649
3Y	0,0380	-1	-6	0,3555	0,9897	1,4654
4Y	0,2060	-1	-8	0,5161	1,1085	1,5547
5Y	0,3640	-1	-9	0,6617	1,2177	1,6290
7Y	0,6450	0	-9	0,9140	1,4022	1,7502
10Y	0,9820	0	-8	1,2054	1,5866	1,8573
15Y	1,3290	0	-7	1,4733	1,7310	1,9075
20Y	1,4810	0	-6	1,5840	1,7639	1,8733
30Y	1,5320	1	-6	1,5980	1,7130	1,7799

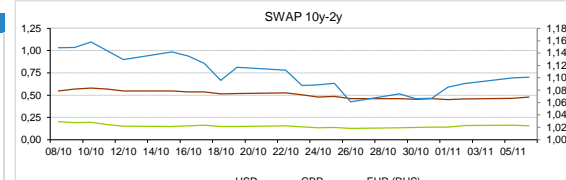
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



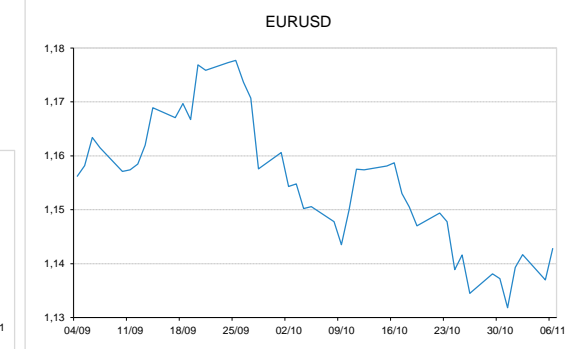
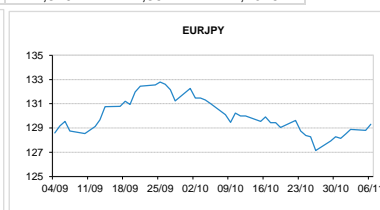
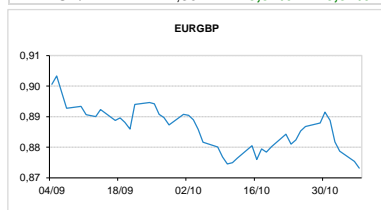
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,9290	1	14	3,2695	3,1910	3,2340
2Y	3,0980	2	12	3,2520	3,2105	3,2904
3Y	3,1420	2	11	3,2330	3,2040	3,2910
4Y	3,1540	3	11	3,2389	3,2220	3,3200
5Y	3,1610	3	11	3,2437	3,2380	3,3708
7Y	3,1900	3	12	3,2480	3,2960	3,3780
10Y	3,2480	3	15	3,3237	3,3430	3,3930
15Y	3,3090	3	17	3,3630	3,3855	3,3910
20Y	3,3240	3	17	3,3460	3,3530	3,3650
30Y	3,3070	3	19	3,3130	3,3366	3,3396



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	71,33	-1,84	-12,46	OT 2Y	-0,145	0,00	-5,20
JETFUEL	710,02	-9,94	-81,32	OT 5Y	0,706	0,01	-7,30
DIESEL	671,02	-8,44	-75,82	OT 10Y	1,898	0,01	-4,40
COBRE	6.182,00	-92,00	18,00	BUND 10Y	0,025	0,53	-15,60
ZINCO	2.565,50	-36,00	-107,50	SCHATZ 2Y	0,028	0,46	-8,50
OURO	1.226,49	-3,65	25,08	T-NOTE 10Y	3,816	1,37	-3,80
TRIGO	513,00	5,75	-8,00	T-NOTE 2Y	3,279	1,57	0,00
LICENÇA C02	17,55	0,32	-4,61	GILT 10Y	1,664	3,31	-16,90


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1428	0,51%	-0,44%	1,1525	1,1617	1,1822
EUR/GBP	0,87313	0,25%	0,80%	0,8763	0,8794	0,8864
EUR/JPY	129,31	-0,39%	0,62%	129,31	129,31	129,31
EUR/CHF	1,1465	-0,12%	-0,55%	1,1453	1,1442	1,1418
EUR/BRL	4,2827	-0,56%	1,45%	4,3487	4,4115	4,5688
EUR/PLN	4,3042	0,04%	0,37%	4,3292	4,3521	4,4016

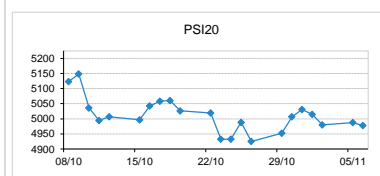

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1428	0,8731	129,31	1,1465	10,3518	7,4592	1,4998	1,58129	4,2827	9,5572
USD	0,8759	-	0,7646	113,365	1,0037	9,0596	6,5341	1,3122	1,3840	3,7537	8,3639

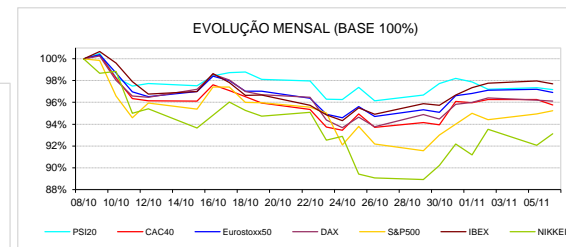
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,270	-0,95	40,59
BCP	0,245	0,53	-10,07
CORT. AMORIM	9,600	-2,04	-6,80
CTT	3,350	0,36	-4,48
EDP	3,115	0,61	7,97
EDP R	7,820	-0,89	12,24
GALP	15,000	-0,10	-2,12
IBERSOL	8,440	-0,24	-16,64
J MARTINS	10,675	-1,16	-34,08
MOTA ENGIL	1,708	-1,16	-53,37
NAVIGATOR	4,150	0,68	-1,66
NOS	5,120	0,00	-6,59
NOVABASE	2,490	0,40	-18,33
PHAROL	0,153	0,39	-38,72
REN	2,378	0,34	-4,07
SEMAPA	15,780	-1,13	-11,32
SONAE CAP.	0,750	-1,45	-15,45
SONAE SGPS	0,861	-1,38	-23,58

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NAVIGATOR	0,68
EDP	0,61
BCP	0,53
NOVABASE	0,40
PHAROL	0,39
J MARTINS	-1,16
J MARTINS	-1,16
SONAE SGPS	-1,38
SONAE CAP.	-1,45
CORT. AMORIM	-2,04



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.977,68	-0,20%	-7,62%	5.801,45	4.893,44
CAC40	5.075,19	-0,51%	-4,47%	5.657,44	4.896,80
ESTX 50 PR	3.207,42	-0,31%	-8,46%	3.695,32	3.090,85
XTRA DAX	11.484,34	-0,09%	-11,10%	13.596,89	11.051,04
S&P 500	2.747,00	0,32%	2,74%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.988,90	-0,24%	-10,50%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	22.147,75	1,14%	-2,71%	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.