

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

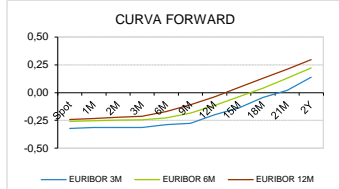
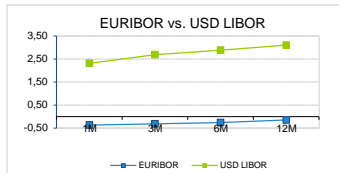
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

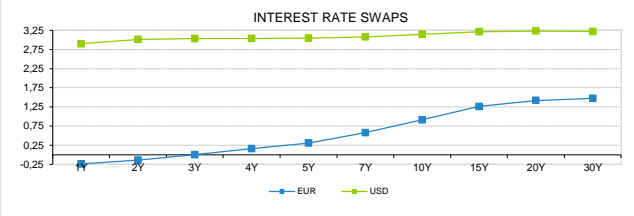
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,3149	0	3	0,7339	-0,7868
3M	-0,3160	0	0	3M	2,6893	1	20	0,8943	-0,7452
6M	-0,2570	0	0	6M	2,8873	0	16	1,0010	-0,6672
12M	-0,1470	0	0	12M	3,1095	0	8	1,1447	-0,5320

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2419	0	-1	-0,0397	0,6154	1,1524
2Y	-0,1400	-1	-3	0,1297	0,7554	1,2633
3Y	0,0050	-1	-6	0,2900	0,8868	1,3652
4Y	0,1590	-1	-8	0,4394	1,0068	1,4480
5Y	0,3070	-2	-9	0,5795	1,1178	1,5335
7Y	0,5780	-2	-11	0,8280	1,3010	1,6611
10Y	0,9110	-2	-11	1,1187	1,4983	1,7710
15Y	1,2610	-2	-10	1,3979	1,6541	1,8300
20Y	1,4180	-2	-9	1,5149	1,6922	1,8000
30Y	1,4720	-2	-9	1,5335	1,6480	1,7130

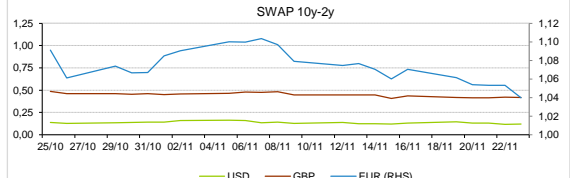
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



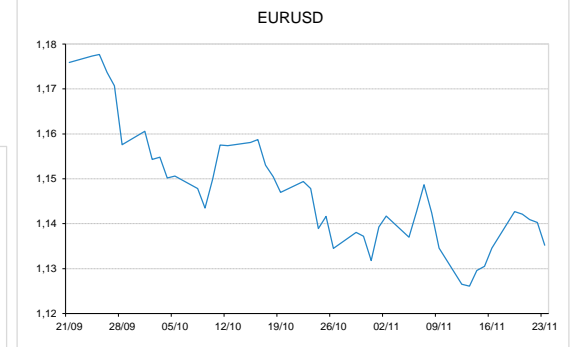
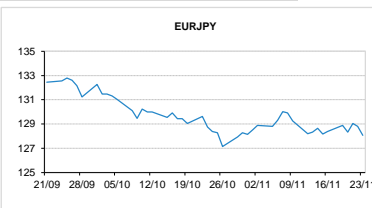
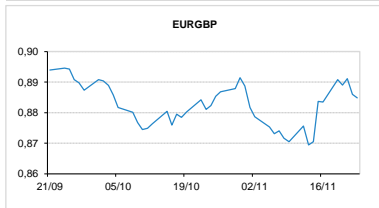
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8990	2	1	3,0771	3,0284	3,0942
2Y	3,0100	2	-10	3,0440	3,0220	3,0980
3Y	3,0330	3	-14	3,0490	3,0584	3,1611
4Y	3,0380	3	-15	3,0330	3,0838	3,1928
5Y	3,0450	3	-15	3,0581	3,0840	3,2225
7Y	3,0760	2	-14	3,0720	3,1410	3,2629
10Y	3,1410	2	-12	3,1410	3,2203	3,2888
15Y	3,2110	2	-10	3,1930	3,2260	3,2893
20Y	3,2310	2	-9	3,2259	3,2473	3,2410
30Y	3,2180	2	-8	3,1830	3,2125	3,1960



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	58,90	-3,70	-17,25	OT 2Y	-0,186	-0,01	-6,30
JETFUEL	620,12	-22,38	-129,13	OT 5Y	0,737	0,00	-6,40
DIESEL	583,75	-20,50	-124,50	OT 10Y	1,945	0,00	-3,50
COBRE	6.267,00	20,00	13,00	BUND 10Y	-0,081	-3,36	-6,70
ZINCO	2.626,00	18,50	60,00	SCHATZ 2Y	0,011	-0,46	0,60
OURO	1.222,66	-4,64	-8,47	T-NOTE 10Y	3,673	-1,01	-7,60
TRIGO	509,00	2,25	-20,25	T-NOTE 2Y	3,153	-0,79	-5,90
LICENÇA C02	20,34	-0,58	1,11	GILT 10Y	1,504	-3,75	-8,10


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1352	-0,45%	-1,10%	1,1449	1,1540	1,1735
EUR/GBP	0,8848	0,13%	-0,43%	0,8881	0,8912	0,8978
EUR/JPY	128,07	0,57%	0,54%	128,07	128,07	128,07
EUR/CHF	1,1310	0,36%	0,99%	1,1298	1,1287	1,1262
EUR/BRL	4,3328	0,13%	-2,20%	4,3982	4,4600	4,6092
EUR/PLN	4,2899	0,11%	0,05%	4,3145	4,3375	4,3861

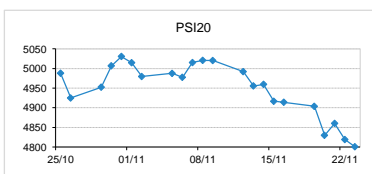

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1352	0,8848	128,07	1,1310	10,3035	7,4614	1,4992	1,56835	4,3328	9,7458
USD	0,8813	-	0,7808	112,765	0,9969	9,0797	6,5761	1,3233	1,3832	3,8158	8,5859

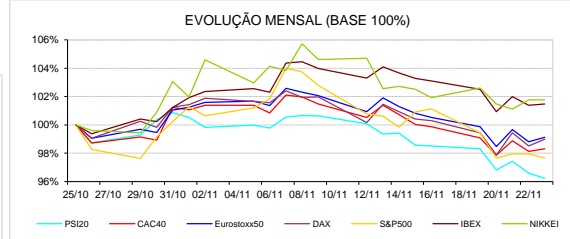
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	6,600	-3,08	27,63
BCP	0,236	0,25	-13,20
CORT. AMORIM	9,230	1,43	-10,39
CTT	3,340	0,66	-4,76
EDP	3,045	0,13	5,55
EDP R	7,535	0,13	8,15
GALP	14,405	-2,01	-6,00
IBERSOL	8,100	-0,74	-20,00
J MARTINS	10,640	1,33	-34,30
MOTA ENGIL	1,520	1,74	-58,50
NAVIGATOR	3,644	-3,39	-13,65
NOS	5,060	-0,20	-7,68
NOVABASE	2,380	0,00	-21,94
PHAROL	0,175	-1,24	-30,00
REN	2,398	-0,33	-3,27
SEMAPA	14,100	-0,42	-20,76
SONAE CAP.	0,765	0,00	-13,75
SONAE SGPS	0,822	0,37	-27,00

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	1,74
CORT. AMORIM	1,43
J MARTINS	1,33
CTT	0,66
SONAE SGPS	0,37
IBERSOL	-0,74
PHAROL	-1,24
GALP	-2,01
ALTRI	-3,08
NAVIGATOR	-3,39



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.800,59	-0,38%	-10,91%	5.801,45	4.783,34
CAC40	4.946,95	0,18%	-6,88%	5.657,44	4.894,30
ESTX 50 PR	3.137,06	0,33%	-10,47%	3.687,22	3.090,85
XTRA DAX	11.192,69	0,49%	-13,35%	13.596,89	11.009,25
S&P 500	2.641,84	-0,29%	-1,17%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.916,70	0,10%	-11,24%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	21.646,55	0,65%	-4,91%	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.