

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

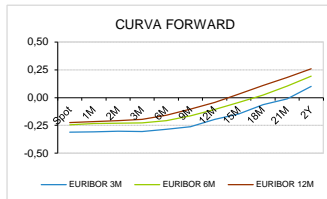
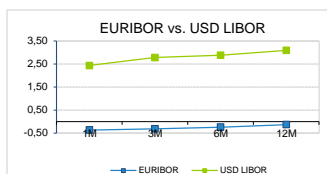
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

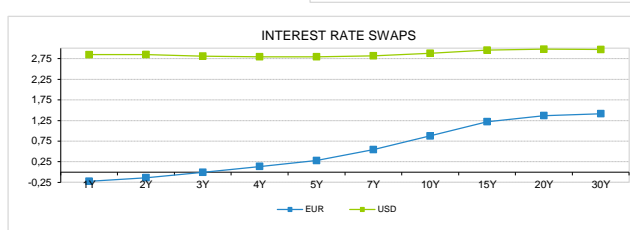
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4324	1	12	0,7306	-0,8322
3M	-0,3120	0	0	3M	2,7790	0	16	0,9004	-0,7400
6M	-0,2410	0	2	6M	2,8806	0	2	1,0204	-0,6644
12M	-0,1310	0	2	12M	3,0895	1	-5	1,1452	-0,5268

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2247	0	1	-0,0435	0,5760	1,1120
2Y	-0,1360	1	-2	0,1091	0,7205	1,2290
3Y	-0,0070	1	-6	0,2635	0,8520	1,3325
4Y	0,1370	2	-8	0,4135	0,9740	1,4255
5Y	0,2800	2	-9	0,5529	1,0850	1,5120
7Y	0,5460	3	-10	0,8020	1,2770	1,6300
10Y	0,8760	3	-10	1,0965	1,4689	1,7380
15Y	1,2220	3	-10	1,3655	1,6130	1,7825
20Y	1,3700	2	-10	1,4725	1,6427	1,7425
30Y	1,4140	2	-11	1,4775	1,5860	1,6490

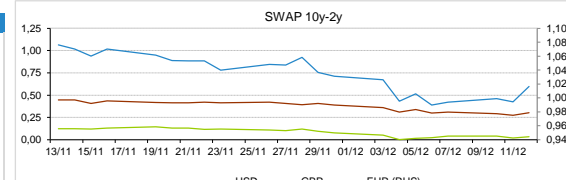
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



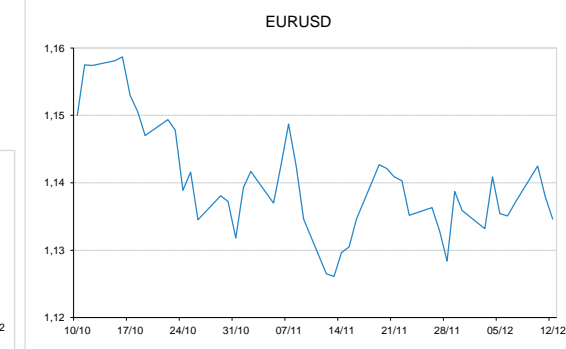
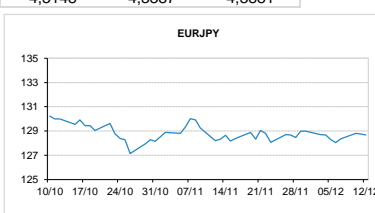
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8440	-4	-11	2,9354	2,8325	2,8770
2Y	2,8460	-7	-28	2,8710	2,8190	2,8990
3Y	2,8100	-8	-35	2,8692	2,8390	2,9420
4Y	2,7960	-8	-37	2,8663	2,8640	2,9963
5Y	2,7950	-8	-38	2,8708	2,8560	3,0277
7Y	2,8170	-8	-38	2,8860	2,9693	3,0632
10Y	2,8780	-8	-37	2,9721	3,0215	3,0880
15Y	2,9530	-8	-35	3,0199	3,0499	3,0883
20Y	2,9770	-8	-34	2,9970	3,0140	3,0370
30Y	2,9690	-8	-33	2,9755	2,9805	3,0212



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	61,04	0,84	-9,35	OT 2Y	-0,301	-0,02	-14,20
JETFUEL	612,50	7,30	-101,25	OT 5Y	0,495	-0,02	-25,90
DIESEL	568,50	6,05	-104,75	OT 10Y	1,722	-0,04	-22,60
COBRE	6.146,00	79,00	112,00	BUND 10Y	-0,217	4,11	-13,80
ZINCO	2.642,00	16,50	97,00	SCHATZ 2Y	0,083	3,22	0,70
OURO	1.245,75	1,38	42,39	T-NOTE 10Y	3,575	2,01	-22,40
TRIGO	526,25	5,25	-0,25	T-NOTE 2Y	3,082	1,57	-19,70
LICENÇA C02	21,38	1,22	0,88	GILT 10Y	1,483	7,44	-16,90


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1346	-0,29%	0,72%	1,1437	1,1530	1,1722
EUR/GBP	0,90135	0,10%	-2,85%	0,9043	0,9076	0,9145
EUR/JPY	128,67	0,06%	-0,37%	128,67	128,67	128,67
EUR/CHF	1,1274	-0,27%	0,61%	1,1262	1,1251	1,1226
EUR/BRL	4,3752	1,00%	-3,21%	4,4355	4,5045	4,6516
EUR/PLN	4,2917	0,22%	0,18%	4,3148	4,3387	4,3881

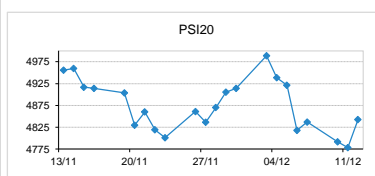

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1346	0,9014	128,67	1,1274	10,3344	7,4641	1,5160	1,57339	4,3752	9,7343
USD	0,8798	-	0,7897	113,195	0,9921	9,0898	6,5665	1,3331	1,3836	3,8448	8,5618

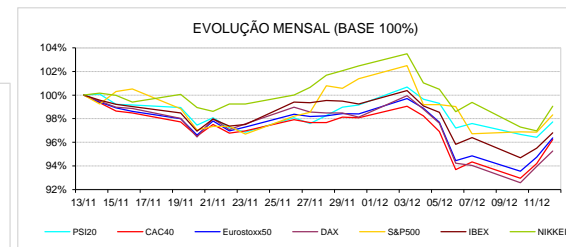
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	5,850	2,81	13,13
BCP	0,246	2,37	-9,52
CORT. AMORIM	9,500	1,71	-7,77
CTT	3,182	0,19	-9,27
EDP	3,110	0,00	7,80
EDP R	7,785	1,70	11,74
GALP	14,290	-0,10	-6,75
IBERSOL	8,340	1,71	-17,63
J MARTINS	10,335	1,92	-36,18
MOTA ENGIL	1,598	1,65	-56,37
NAVIGATOR	3,578	1,19	-15,22
NOS	5,345	1,81	-2,48
NOVABASE	2,350	-0,42	-22,93
PHAROL	0,178	-0,34	-28,80
REN	2,430	1,33	-1,98
SEMAPA	13,540	3,83	-23,91
SONAE CAP.	0,899	2,63	1,35
SONAE SGPS	0,820	2,50	-27,18

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
SEMAPA	3,83
ALTRI	2,81
SONAE CAP.	2,63
SONAE SGPS	2,50
BCP	2,37
GALP	-0,10
PHAROL	-0,34
NOVABASE	-0,42



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.842,58	1,35%	-10,13%	5.801,45	4.773,78
CAC40	4.909,45	2,15%	-7,59%	5.657,44	4.732,02
ESTX 50 PR	3.107,97	1,72%	-11,30%	3.687,22	3.007,53
XTRA DAX	10.929,43	1,38%	-15,39%	13.596,89	10.585,77
S&P 500	2.678,31	1,51%	0,11%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.853,40	1,35%	-11,85%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	21.602,75	2,15%	-5,11%	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.