

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

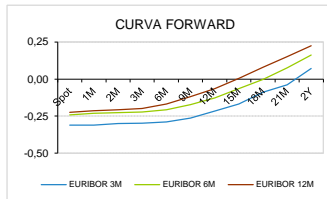
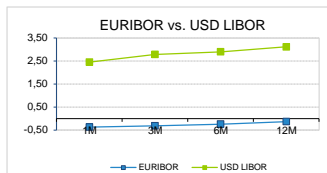
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

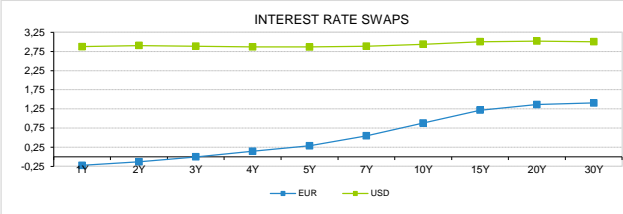
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4551	2	15	0,7300	-0,8244
3M	-0,3110	0	1	3M	2,7882	1	17	0,9000	-0,7372
6M	-0,2380	0	2	6M	2,9009	1	5	1,0295	-0,6568
12M	-0,1280	0	2	12M	3,1124	1	-2	1,1643	-0,5250

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2245	0	1	-0,0666	0,5405	1,0870
2Y	-0,1320	1	-1	0,0802	0,6845	1,2020
3Y	-0,0020	2	-4	0,2322	0,8180	1,3110
4Y	0,1440	2	-5	0,3798	0,9420	1,4108
5Y	0,2850	2	-6	0,5194	1,0578	1,4900
7Y	0,5490	2	-7	0,7708	1,2562	1,6190
10Y	0,8790	2	-8	1,0725	1,4562	1,7360
15Y	1,2190	1	-9	1,3559	1,6116	1,7974
20Y	1,3630	0	-10	1,4710	1,6471	1,7580
30Y	1,4030	-1	-12	1,4882	1,6029	1,6716

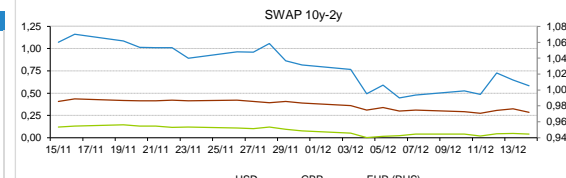
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



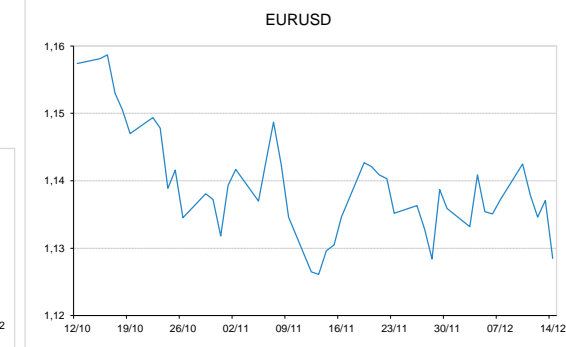
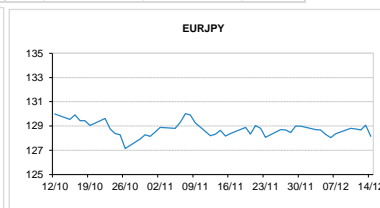
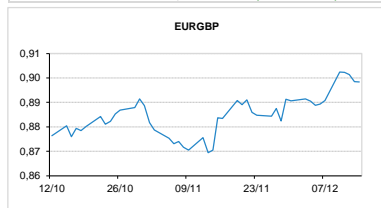
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8740	2	-8	2,8998	2,7510	2,8470
2Y	2,9060	3	-22	2,8250	2,7886	2,8885
3Y	2,8830	4	-28	2,7860	2,7910	2,9537
4Y	2,8680	5	-30	2,8060	2,8240	2,9630
5Y	2,8650	5	-31	2,7900	2,8580	3,0170
7Y	2,8830	5	-31	2,8350	2,9240	3,0340
10Y	2,9390	5	-31	2,9398	3,0044	3,0505
15Y	3,0020	4	-30	2,9755	3,0145	3,0837
20Y	3,0200	4	-30	2,9880	3,0363	3,0290
30Y	3,0050	4	-29	2,9942	3,0043	2,9890



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	60,24	-1,21	-6,23	OT 2Y	-0,332	-0,03	-17,80
JETFUEL	604,00	-1,25	-82,75	OT 5Y	0,416	-0,03	-34,50
DIESEL	560,75	-1,25	-89,88	OT 10Y	1,665	-0,01	-29,80
COBRE	6.153,00	15,00	82,00	BUND 10Y	-0,236	-2,28	-16,80
ZINCO	2.618,00	-7,50	109,00	SCHATZ 2Y	0,046	-1,84	-3,70
OURO	1.239,93	-2,81	31,49	T-NOTE 10Y	3,552	-2,34	-20,80
TRIGO	532,25	-3,75	20,25	T-NOTE 2Y	3,047	-3,13	-18,80
LICENÇA C02	23,43	1,11	3,70	GILT 10Y	1,456	-2,48	-25,10


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1285	-0,76%	-0,10%	1,1376	1,1468	1,1656
EUR/GBP	0,89835	0,01%	-3,10%	0,9013	0,9046	0,9113
EUR/JPY	128,13	0,73%	0,40%	128,13	128,13	128,13
EUR/CHF	1,1264	0,22%	1,01%	1,1252	1,1241	1,1218
EUR/BRL	4,404	0,42%	-2,54%	4,4638	4,5329	4,6793
EUR/PLN	4,2913	0,13%	0,18%	4,3147	4,3386	4,3867

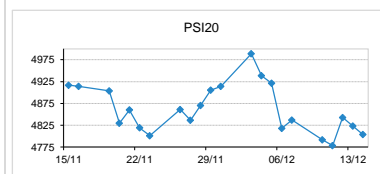

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1285	0,8984	128,13	1,1264	10,2559	7,4658	1,5125	1,5744	4,4040	9,7466
USD	0,8852	-	0,7963	113,425	0,9970	9,0695	6,6087	1,3372	1,3942	3,8959	8,6227

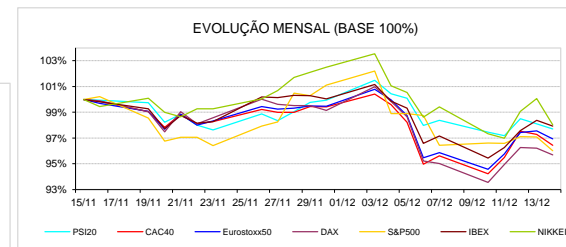
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,610	-1,75	8,49
BCP	0,242	-1,63	-11,10
CORT. AMORIM	9,190	-1,18	-10,78
CTT	3,198	0,50	-8,81
EDP	3,104	0,49	7,59
EDP R	7,745	-1,27	11,17
GALP	14,160	0,32	-7,60
IBERSOL	8,180	0,74	-19,21
J MARTINS	10,315	0,15	-36,31
MOTA ENGIL	1,604	0,25	-56,21
NAVIGATOR	3,512	-0,62	-16,78
NOS	5,310	0,47	-3,12
NOVABASE	2,360	0,43	-22,60
PHAROL	0,185	-2,63	-26,08
REN	2,460	0,08	-0,77
SEMAPA	13,040	-2,10	-26,72
SONAE CAP.	0,896	0,67	1,01
SONAE SGPS	0,816	-1,98	-27,53

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	0,74
SONAE CAP.	0,67
CTT	0,50
EDP	0,49
NOS	0,47
BCP	-1,63
ALTRI	-1,75
SONAE SGPS	-1,98
SEMAPA	-2,10
PHAROL	-2,63



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.803,42	-0,41%	-10,86%	5.801,45	4.773,78
CAC40	4.853,70	-0,88%	-8,64%	5.657,44	4.732,02
ESTX 50 PR	3.092,60	-0,63%	-11,74%	3.687,22	3.007,53
XTRA DAX	10.865,77	-0,54%	-15,88%	13.596,89	10.585,77
S&P 500	2.621,49	-1,10%	-1,95%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.886,10	-0,45%	-11,53%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	21.374,83	-2,02%	-6,11%	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.