

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

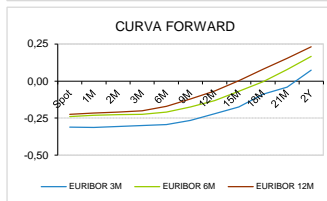
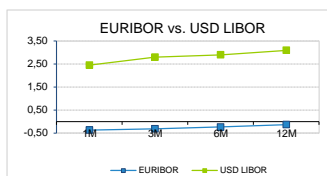
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

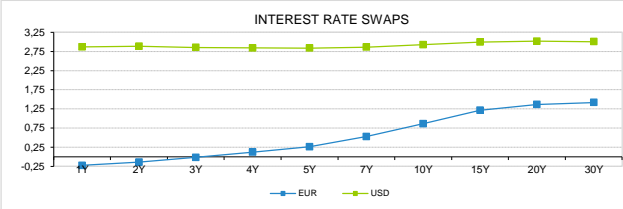
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,4550	0	14	0,7300	-0,8218
3M	-0,3110	0	1	3M	2,8007	1	17	0,9009	-0,7322
6M	-0,2370	0	2	6M	2,9006	0	4	1,0261	-0,6526
12M	-0,1270	0	2	12M	3,0977	-1	-3	1,1610	-0,5242

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2249	0	1	-0,0678	0,5420	1,0999
2Y	-0,1400	-1	-2	0,0806	0,6880	1,2140
3Y	-0,0160	-1	-5	0,2340	0,8250	1,3190
4Y	0,1220	-2	-7	0,3830	0,9490	1,4187
5Y	0,2610	-2	-9	0,5240	1,0630	1,4955
7Y	0,5270	-2	-9	0,7780	1,2590	1,6250
10Y	0,8620	-2	-9	1,0780	1,4628	1,7475
15Y	1,2150	0	-8	1,3636	1,6216	1,7960
20Y	1,3670	0	-9	1,4761	1,6535	1,7630
30Y	1,4180	2	-9	1,4941	1,6089	1,6838

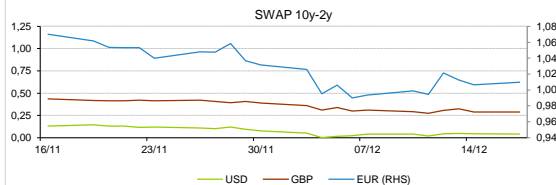
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



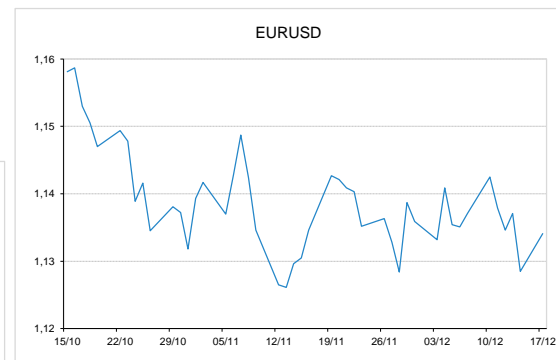
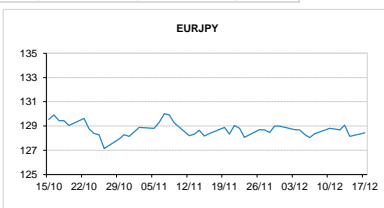
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8670	-1	-6	2,8887	2,7530	2,8450
2Y	2,8830	-2	-20	2,7940	2,7685	2,8800
3Y	2,8560	-2	-26	2,8051	2,7920	2,9160
4Y	2,8400	-2	-28	2,7690	2,8240	2,9470
5Y	2,8380	-2	-28	2,7950	2,8445	3,0042
7Y	2,8640	-2	-29	2,8270	2,9150	3,0170
10Y	2,9280	-1	-29	2,9080	2,9720	3,0430
15Y	2,9970	-1	-28	2,9660	3,0050	3,0480
20Y	3,0180	-1	-28	2,9800	2,9940	3,0200
30Y	3,0060	-1	-28	2,9540	2,9710	2,9800



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	59,51	-0,77	-7,52	OT 2Y	-0,343	-0,01	-19,20
JETFUEL	597,00	-7,00	-84,50	OT 5Y	0,394	-0,02	-38,20
DIESEL	554,25	-6,50	-84,92	OT 10Y	1,650	-0,01	-31,90
COBRE	6.140,50	-23,50	41,50	BUND 10Y	-0,235	0,29	-11,50
ZINCO	2.564,00	-54,00	39,00	SCHATZ 2Y	0,048	0,00	-0,20
OURO	1.243,00	3,16	19,53	T-NOTE 10Y	3,540	-1,84	-21,10
TRIGO	535,50	5,50	20,25	T-NOTE 2Y	3,031	-2,35	-20,10
LICENÇA C02	24,13	0,76	5,02	GILT 10Y	1,470	2,20	-10,50


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1341	0,50%	-0,75%	1,1431	1,1523	1,1712
EUR/GBP	0,8989	-0,06%	-0,90%	0,9019	0,9051	0,9120
EUR/JPY	128,44	-0,24%	0,35%	128,44	128,44	128,44
EUR/CHF	1,1265	0,14%	0,95%	1,1253	1,1241	1,1219
EUR/BRL	4,4126	0,23%	-2,39%	4,4733	4,5419	4,6873
EUR/PLN	4,2817	0,24%	1,22%	4,3050	4,3286	4,3764

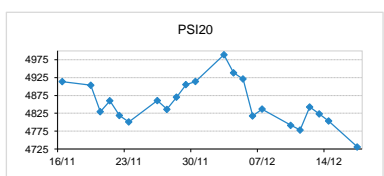

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1341	0,8989	128,44	1,1265	10,2599	7,4669	1,5180	1,57868	4,4126	9,7854
USD	0,8821	-	0,793	112,995	0,9943	9,0452	6,5871	1,3380	1,3927	3,9100	8,6279

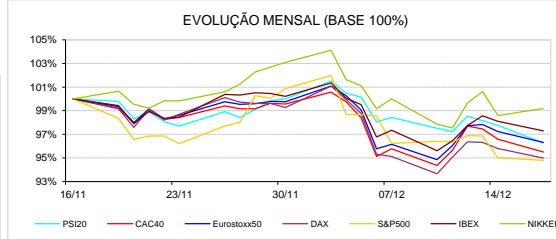
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	5,470	-2,50	5,78
BCP	0,237	-1,90	-12,79
CORT. AMORIM	9,160	0,60	-11,07
CTT	3,202	0,13	-8,70
EDP	3,027	-2,48	4,92
EDP R	7,640	-1,36	9,66
GALP	14,070	-0,64	-8,19
IBERSOL	8,080	-1,22	-20,20
J MARTINS	10,135	-1,75	-37,42
MOTA ENGIL	1,594	-0,62	-56,48
NAVIGATOR	3,424	-2,51	-18,87
NOS	5,250	-1,13	-4,21
NOVABASE	2,290	-2,97	-24,89
PHAROL	0,181	-2,16	-27,68
REN	2,444	-0,65	-1,41
SEMAPA	12,780	-1,99	-28,18
SONAE CAP.	0,899	0,33	1,35
SONAE SGPS	0,796	-2,51	-29,35

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	0,60
SONAE CAP.	0,33
CTT	0,13
EDP	-2,48
ALTRI	-2,50
NAVIGATOR	-2,51
SONAE SGPS	-2,51
NOVABASE	-2,97



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.730,62	-1,52%	-12,21%	5.801,45	4.727,66
CAC40	4.799,87	-1,11%	-9,65%	5.657,44	4.732,02
ESTX 50 PR	3.063,65	-0,94%	-12,57%	3.687,22	3.007,53
XTRA DAX	10.772,20	-0,86%	-16,61%	13.596,89	10.585,77
S&P 500	2.593,93	-0,23%	-2,98%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.812,50	-0,83%	-12,26%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	21.506,88	0,62%	-5,53%	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.