

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

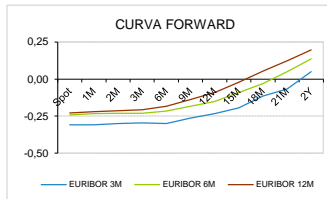
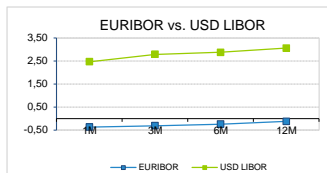
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

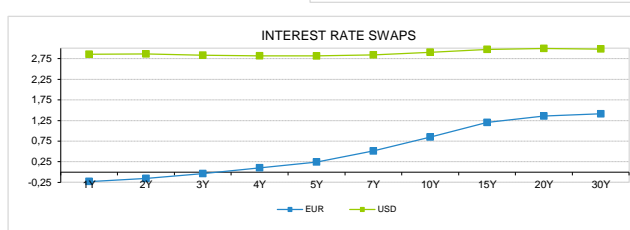
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,4701	0	17	0,7304	-0,8288
3M	-0,3090	0	1	3M	2,7920	-1	15	0,9060	-0,7368
6M	-0,2380	0	2	6M	2,8764	-3	1	1,0208	-0,6574
12M	-0,1240	0	2	12M	3,0613	-4	-6	1,1608	-0,5242

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2285	0	1	-0,0907	0,5111	1,0646
2Y	-0,1540	-1	-3	0,0545	0,6557	1,1802
3Y	-0,0360	-1	-6	0,2073	0,7913	1,2873
4Y	0,1030	-2	-8	0,3559	0,9154	1,3811
5Y	0,2450	-1	-8	0,4944	1,0305	1,4635
7Y	0,5110	-1	-9	0,7472	1,2259	1,5927
10Y	0,8470	-1	-9	1,0450	1,4231	1,7082
15Y	1,2010	-2	-9	1,3252	1,5779	1,7632
20Y	1,3560	-2	-10	1,4398	1,6151	1,7303
30Y	1,4110	-1	-10	1,4578	1,5709	1,6390

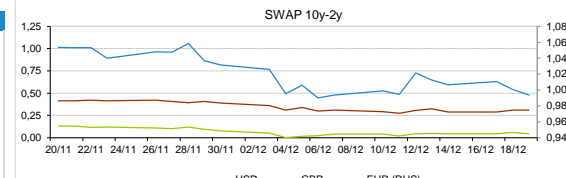
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



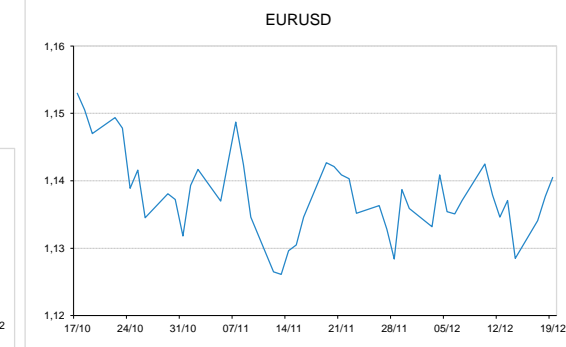
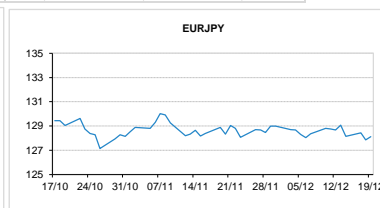
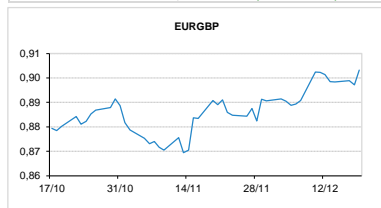
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8560	-1	-5	2,7692	2,6665	2,7710
2Y	2,8630	-2	-16	2,6705	2,6980	2,8075
3Y	2,8310	-3	-21	2,6840	2,7125	2,8450
4Y	2,8160	-2	-23	2,6870	2,7425	2,8800
5Y	2,8140	-2	-24	2,7105	2,7815	2,9336
7Y	2,8390	-3	-25	2,7520	2,8440	2,9490
10Y	2,9030	-3	-25	2,8325	2,9000	2,9700
15Y	2,9730	-2	-26	2,8860	2,9265	2,9755
20Y	2,9940	-2	-26	2,8995	2,9260	2,9460
30Y	2,9830	-2	-26	2,8775	2,9219	2,8945



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	57,53	1,27	-9,55	OT 2Y	-0,368	-0,03	-21,30
JETFUEL	583,00	6,15	-94,50	OT 5Y	0,384	0,01	-40,30
DIESEL	541,82	6,82	-93,68	OT 10Y	1,648	0,01	-33,80
COBRE	5.956,00	-153,00	-235,00	BUND 10Y	-0,254	-0,59	-14,90
ZINCO	2.533,00	-19,50	-85,00	SCHATZ 2Y	0,053	0,00	-0,90
OURO	1.254,52	5,34	30,53	T-NOTE 10Y	3,502	-0,67	-19,30
TRIGO	524,00	-8,75	17,50	T-NOTE 2Y	2,965	0,00	-16,80
LICENÇA C02	24,60	0,27	5,29	GILT 10Y	1,487	-1,72	-10,10


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1405	0,25%	-0,19%	1,1497	1,1590	1,1780
EUR/GBP	0,90318	-0,67%	-1,37%	0,9063	0,9095	0,9166
EUR/JPY	128,11	-0,20%	0,61%	128,11	128,11	128,11
EUR/CHF	1,1331	-0,41%	0,37%	1,1318	1,1306	1,1285
EUR/BRL	4,4228	0,33%	-2,63%	4,4831	4,5522	4,6988
EUR/PLN	4,2828	0,03%	1,19%	4,3069	4,3306	4,3789

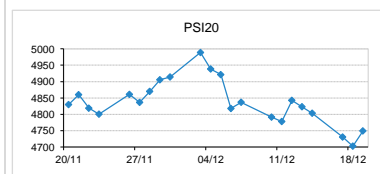

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1405	0,9032	128,11	1,1331	10,3449	7,4677	1,5343	1,59282	4,4228	9,8890
USD	0,8755	-	0,7909	112,285	0,9929	9,0655	6,5380	1,3420	1,3938	3,8691	8,6756

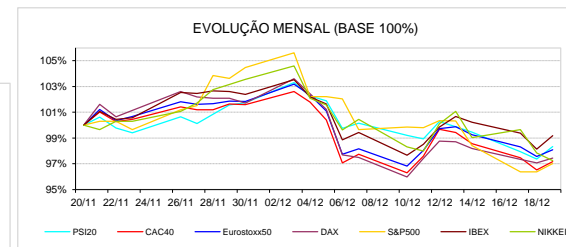
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	5,720	3,81	10,62
BCP	0,236	1,20	-13,16
CORT. AMORIM	9,080	-0,87	-11,02
CTT	3,128	-1,94	-10,81
EDP	2,997	1,56	3,88
EDP R	7,665	1,12	10,02
GALP	14,040	1,70	-8,38
IBERSOL	8,000	-0,74	-20,99
J MARTINS	10,220	0,69	-36,89
MOTA ENGIL	1,642	-0,61	-55,17
NAVIGATOR	3,492	-0,11	-17,25
NOS	5,335	0,85	-2,66
NOVABASE	2,210	-1,34	-27,52
PHAROL	0,179	0,00	-28,48
REN	2,448	1,24	-1,25
SEMAPA	12,880	1,74	-27,62
SONAE CAP.	0,874	-2,56	-1,47
SONAE SGPS	0,820	1,24	-27,22

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
ALTRI	3,81
SEMAPA	1,74
GALP	1,70
EDP	1,56
REN	1,24
IBERSOL	-0,74
CORT. AMORIM	-0,87
NOVABASE	-1,34
CTT	-1,94
SONAE CAP.	-2,56



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.749,10	0,99%	-11,86%	5.801,45	4.686,25
CAC40	4.785,23	0,66%	-9,93%	5.657,44	4.732,02
ESTX 50 PR	3.056,36	0,53%	-12,77%	3.687,22	3.007,53
XTRA DAX	10.784,20	0,40%	-16,52%	13.596,89	10.585,77
S&P 500	2.562,43	0,67%	-4,13%	2.940,91	2.528,71
IBEX 35	8.793,10	1,06%	-12,45%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	20.987,92	-0,60%	-7,81%	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.