

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

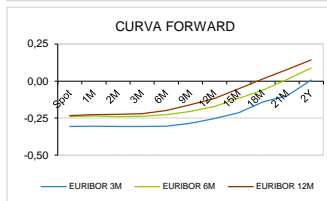
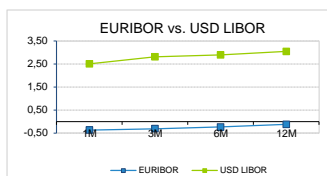
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

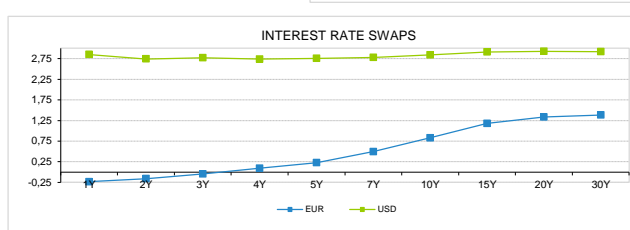
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3640	0	1	1M	2,5056	0	18	0,7305	-0,8208
3M	-0,3090	0	1	3M	2,8134	-1	12	0,9071	-0,7276
6M	-0,2370	0	2	6M	2,8938	-1	1	1,0331	-0,6556
12M	-0,1190	0	3	12M	3,0479	-3	-7	1,1674	-0,5084

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2330	0	1	-0,1170	0,4720	1,0367
2Y	-0,1590	0	-3	0,0121	0,6210	1,1640
3Y	-0,0450	0	-6	0,1668	0,7601	1,2710
4Y	0,0910	0	-8	0,3175	0,8900	1,3680
5Y	0,2300	0	-9	0,4603	1,0070	1,4560
7Y	0,4950	1	-10	0,7175	1,2070	1,5800
10Y	0,8300	1	-10	1,0251	1,4108	1,6940
15Y	1,1800	1	-10	1,3068	1,5647	1,7490
20Y	1,3330	1	-10	1,4249	1,6030	1,7140
30Y	1,3830	1	-11	1,4433	1,5579	1,6269

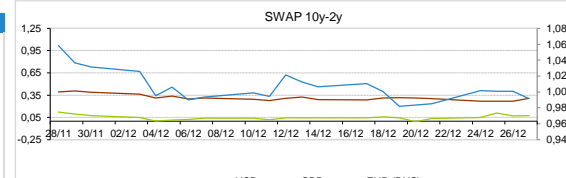
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



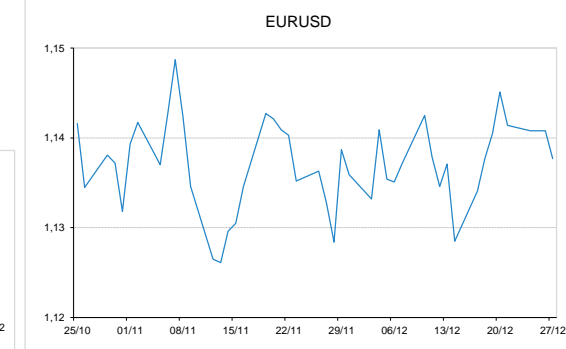
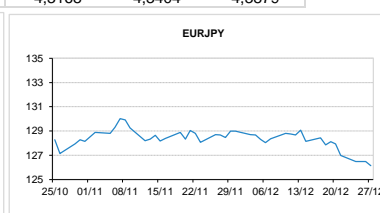
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8510	5	-3	2,6329	2,6241	2,7510
2Y	2,7430	-7	-25	2,5600	2,6520	2,7615
3Y	2,7710	1	-26	2,5780	2,6966	2,8025
4Y	2,7390	0	-27	2,5990	2,7015	2,8450
5Y	2,7570	3	-29	2,6480	2,7360	2,9003
7Y	2,7800	3	-30	2,6815	2,8040	2,9130
10Y	2,8410	3	-30	2,7935	2,8640	2,9350
15Y	2,9110	4	-30	2,8360	2,8920	2,9576
20Y	2,9290	4	-30	2,8737	2,8870	2,9369
30Y	2,9200	4	-30	2,8585	2,8796	2,8914



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	52,95	-1,52	-7,45	OT 2Y	-0,347	0,00	-14,50
JETFUEL	548,50	-7,25	-74,75	OT 5Y	0,411	0,00	-25,70
DIESEL	508,50	-7,93	-76,50	OT 10Y	1,684	0,00	-19,80
COBRE	5.959,00	-35,50	-251,50	BUND 10Y	-0,272	-2,27	-13,40
ZINCO	2.488,00	-27,50	-53,00	SCHATZ 2Y	0,021	-2,76	-4,30
OURO	1.276,99	7,07	63,75	T-NOTE 10Y	3,459	-3,15	-23,80
TRIGO	507,50	-2,50	1,00	T-NOTE 2Y	2,879	-3,12	-29,80
LICENÇA C02	25,07	-0,11	5,11	GILT 10Y	1,520	4,12	-6,20


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1377	-0,27%	0,43%	1,1463	1,1554	1,1742
EUR/GBP	0,90073	-0,04%	-1,47%	0,9036	0,9069	0,9140
EUR/JPY	126,14	0,26%	2,00%	126,14	126,14	126,14
EUR/CHF	1,1300	-0,07%	-0,18%	1,1289	1,1277	1,1256
EUR/BRL	4,4381	0,47%	-1,34%	4,4919	4,5565	4,6907
EUR/PLN	4,2941	-0,21%	0,06%	4,3168	4,3404	4,3879

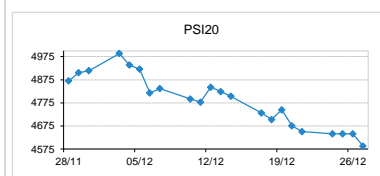

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1377	0,9007	126,14	1,1300	10,2922	7,4676	1,5595	1,62722	4,4381	10,0389
USD	0,8768	-	0,7912	110,745	0,9899	9,0220	6,5458	1,3637	1,4232	3,9100	8,7920

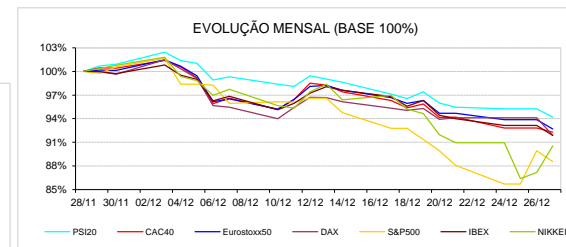
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	5,480	0,00	5,98
BCP	0,221	-2,56	-18,68
CORT. AMORIM	8,480	-0,59	-16,90
CTT	2,934	0,14	-16,34
EDP	2,920	-2,14	1,21
EDP R	7,560	-0,53	8,51
GALP	13,480	-0,30	-12,04
IBERSOL	7,880	-1,99	-22,17
J MARTINS	10,120	0,15	-37,51
MOTA ENGIL	1,506	-1,18	-58,89
NAVIGATOR	3,470	-1,59	-17,78
NOS	5,100	-2,49	-6,95
NOVABASE	2,090	-0,48	-31,45
PHAROL	0,167	-3,36	-33,20
REN	2,400	-0,17	-3,19
SEMAPA	12,960	1,89	-27,17
SONAE CAP.	0,851	0,12	-4,06
SONAE SGPS	0,784	-0,88	-30,37

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SEMAPA	1,89
J MARTINS	0,15
CTT	0,14
SONAE CAP.	0,12
IBERSOL	-1,99
EDP	-2,14
NOS	-2,49
BCP	-2,56
PHAROL	-3,36



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.587,45	-1,14%	-14,86%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.598,61	-0,60%	-13,44%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	2.937,36	-1,22%	-16,17%	3.687,22	2.908,70
XTRA DAX	10.381,51	-2,37%	-19,63%	13.596,89	10.279,20
S&P 500	2.429,29	-1,53%	-9,11%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	8.363,90	-1,38%	-16,73%	10.643,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.077,62	3,88%	-11,80%	24.448,07	18.948,58



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.