

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

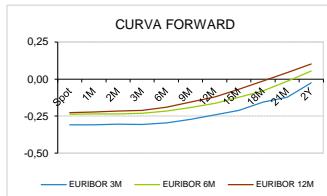
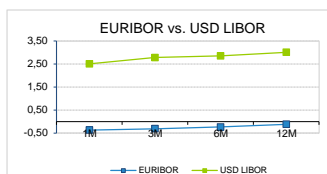
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

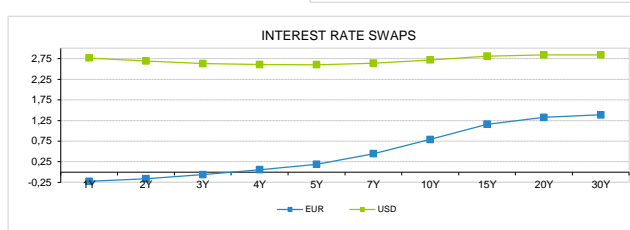
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,5101	0	6	0,7343	-0,7814
3M	-0,3080	0	0	3M	2,7789	-1	-2	0,9216	-0,7034
6M	-0,2360	0	0	6M	2,8534	-1	-5	1,0426	-0,6408
12M	-0,1170	0	1	12M	3,0109	-1	-9	1,1818	-0,5002

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2272	0	0	-0,1223	0,3887	0,9700
2Y	-0,1630	-1	-2	-0,0106	0,5363	1,0950
3Y	-0,0630	-2	-5	0,1207	0,6803	1,2140
4Y	0,0590	-2	-6	0,2607	0,8130	1,3180
5Y	0,1880	-2	-7	0,4009	0,9390	1,4100
7Y	0,4470	-2	-8	0,6640	1,1520	1,5595
10Y	0,7890	-2	-7	0,9830	1,3765	1,6820
15Y	1,1590	-2	-6	1,2876	1,5513	1,7500
20Y	1,3240	-1	-4	1,4154	1,5979	1,7210
30Y	1,3860	-1	-3	1,4425	1,5590	1,6360

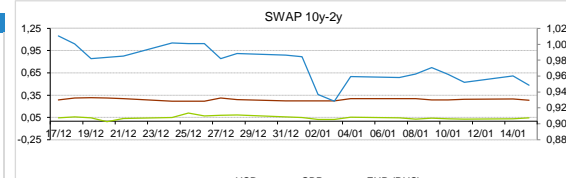
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7660	-1	-9	2,6323	2,5498	2,6915
2Y	2,6910	-1	-18	2,5804	2,5645	2,7310
3Y	2,6280	-1	-21	2,5667	2,6070	2,7740
4Y	2,6040	-2	-22	2,5803	2,6727	2,8386
5Y	2,6030	-2	-22	2,6075	2,6900	2,8763
7Y	2,6380	-2	-20	2,6460	2,7630	2,9060
10Y	2,7170	-2	-18	2,7420	2,8628	2,9644
15Y	2,8100	-2	-15	2,8478	2,9093	2,9460
20Y	2,8380	-2	-14	2,8734	2,9161	2,9556
30Y	2,8400	-1	-13	2,8696	2,8923	2,9141

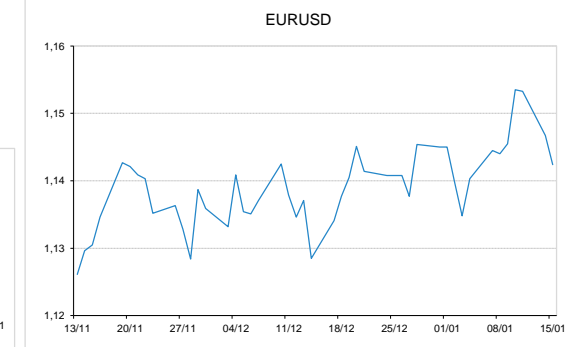
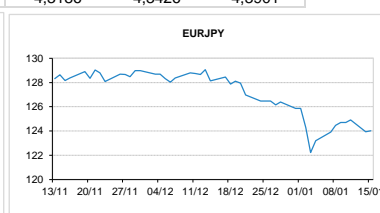


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	60,05	1,06	-0,35	OT 2Y	-0,194	0,00	13,80
JETFUEL	601,25	-11,00	-2,75	OT 5Y	0,433	-0,02	1,70
DIESEL	559,75	-9,50	-1,00	OT 10Y	1,659	-0,02	-0,50
COBRE	5,912,00	-45,00	-234,50	BUND 10Y	-0,360	-2,25	-12,20
ZINCO	2,501,00	-2,00	-43,50	SCHATZ 2Y	0,002	-2,06	-4,60
OURO	1,288,10	-3,69	48,26	T-NOTE 10Y	3,398	0,00	-16,10
TRIGO	511,00	-3,25	-19,00	T-NOTE 2Y	2,867	-0,39	-18,80
LICENÇA C02	22,61	0,06	-1,11	GILT 10Y	1,492	-2,97	4,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1424	-0,38%	0,73%	1,1513	1,1603	1,1789
EUR/GBP	0,89025	0,27%	0,97%	0,8931	0,8962	0,9031
EUR/JPY	124,02	-0,07%	3,56%	124,02	124,02	124,02
EUR/CHF	1,1256	-0,05%	0,08%	1,1246	1,1235	1,1212
EUR/BRL	4,2382	0,02%	4,48%	4,2982	4,3628	4,5042
EUR/PLN	4,2953	-0,10%	-0,30%	4,3186	4,3426	4,3901



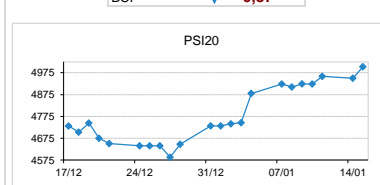
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1424	0,8903	124,02	1,1256	10,2329	7,4635	1,5120	1,58467	4,2382	9,7482
USD	0,8741	-	0,7807	108,52	0,9859	8,9435	6,5244	1,3242	1,3886	3,7146	8,5182

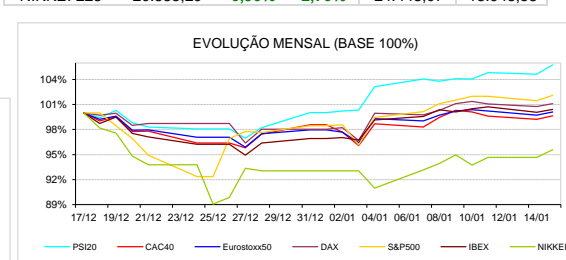
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	6,460	2,70	11,38
BCP	0,240	-0,87	4,49
CORT. AMORIM	9,460	0,21	5,11
CTT	3,044	0,00	3,33
EDP	3,065	-0,42	0,52
EDP R	7,965	0,44	2,44
GALP	14,575	0,14	5,65
IBERSOL	8,580	0,94	8,61
J MARTINS	11,780	9,18	13,93
MOTA ENIGL	1,732	-0,57	7,58
NAVIGATOR	3,956	1,59	9,89
NOS	5,415	-0,73	2,27
NOVABASE	2,070	0,00	2,48
PHAROL	0,186	0,00	13,73
REN	2,536	0,08	4,19
SEMAPA	14,600	0,14	11,45
SONAE CAP.	0,855	-0,70	0,71
SONAE SGPS	0,884	2,43	9,14

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
J MARTINS	9,18
ALTRI	2,70
SONAE SGPS	2,43
NAVIGATOR	1,59
IBERSOL	0,94
EDP	-0,42
MOTA ENIGL	-0,57
SONAE CAP.	-0,70
NOS	-0,73
BCP	-0,87



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.002,54	1,05%	5,73%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.783,11	0,43%	1,11%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.066,68	0,38%	2,17%	3.687,22	2.908,70
XTRA DAX	10.890,00	0,31%	3,14%	13.596,89	10.279,20
S&P 500	2.599,78	0,66%	3,71%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	8.848,90	0,34%	3,62%	10.643,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.555,29	0,96%	2,70%	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.