

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

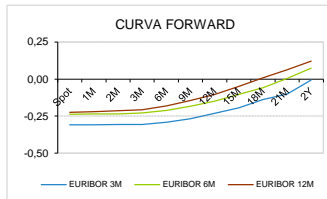
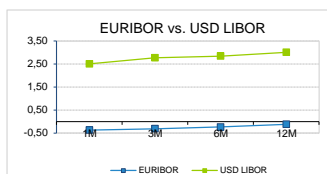
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

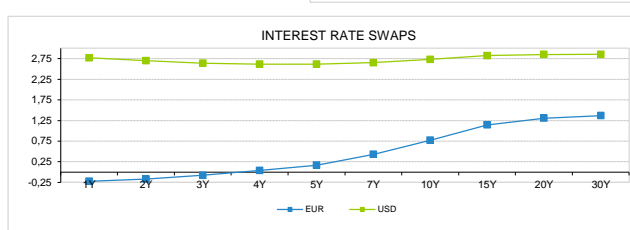
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,5075	0	5	0,7349	-0,7800
3M	-0,3080	0	0	3M	2,7734	-1	-3	0,9279	-0,7020
6M	-0,2360	0	0	6M	2,8458	-1	-5	1,0449	-0,6410
12M	-0,1170	0	1	12M	3,0084	0	-9	1,1868	-0,4986

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2242	0	0	-0,1052	0,4000	0,9740
2Y	-0,1720	-1	-3	0,0101	0,5460	1,1050
3Y	-0,0780	-2	-6	0,1407	0,6880	1,2240
4Y	0,0400	-2	-8	0,2780	0,8230	1,3280
5Y	0,1680	-2	-9	0,4170	0,9490	1,4132
7Y	0,4290	-2	-10	0,6780	1,1610	1,5585
10Y	0,7720	-2	-9	0,9935	1,3823	1,6890
15Y	1,1430	-2	-7	1,2963	1,5575	1,7570
20Y	1,3080	-2	-6	1,4236	1,6048	1,7279
30Y	1,3700	-2	-5	1,4494	1,5648	1,6410

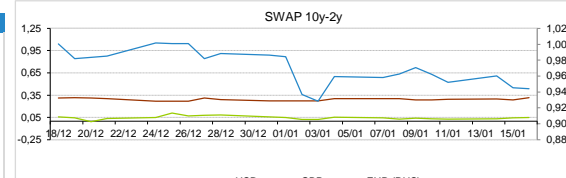
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



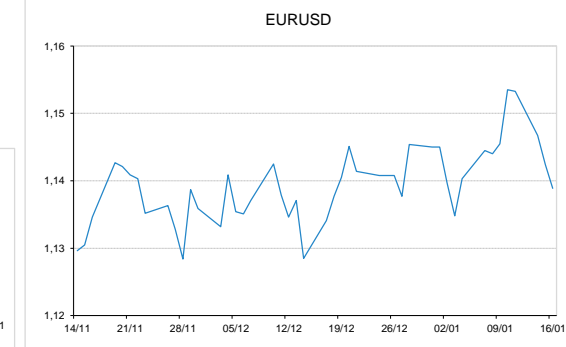
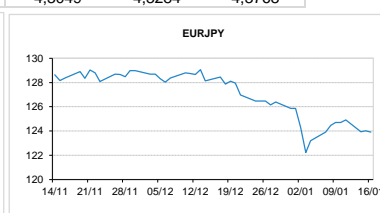
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7680	0	-10	2,6639	2,5550	2,7230
2Y	2,6980	1	-19	2,6068	2,6000	2,7809
3Y	2,6380	1	-22	2,5976	2,6617	2,8123
4Y	2,6140	1	-23	2,6137	2,6680	2,8370
5Y	2,6160	1	-22	2,5935	2,6980	2,8936
7Y	2,6500	1	-21	2,6760	2,7760	2,9423
10Y	2,7280	1	-20	2,7650	2,8420	2,9755
15Y	2,8210	1	-18	2,8420	2,9200	2,9759
20Y	2,8510	1	-17	2,8842	2,8990	2,9350
30Y	2,8520	1	-15	2,8520	2,8963	2,8850



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	60,88	0,24	0,48	OT 2Y	-0,111	0,08	24,00
JETFUEL	609,41	8,16	5,41	OT 5Y	0,587	0,15	19,20
DIESEL	571,91	12,16	11,16	OT 10Y	1,789	0,13	13,80
COBRE	5.906,00	23,00	-211,50	BUND 10Y	-0,340	2,10	-10,70
ZINCO	2.469,50	-31,50	-75,00	SCHATZ 2Y	0,021	1,61	-2,70
OURO	1.294,78	6,70	54,94	T-NOTE 10Y	3,419	2,14	-11,10
TRIGO	514,25	3,25	-15,75	T-NOTE 2Y	2,885	1,75	-13,10
LICENÇA C02	23,39	0,77	-0,33	GILT 10Y	1,540	4,61	6,10


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1389	-0,31%	0,42%	1,1477	1,1568	1,1758
EUR/GBP	0,8859	0,49%	1,47%	0,8887	0,8918	0,8987
EUR/JPY	123,91	0,09%	3,66%	123,91	123,91	123,91
EUR/CHF	1,1290	-0,27%	-0,21%	1,1279	1,1267	1,1244
EUR/BRL	4,2555	-0,31%	4,07%	4,3150	4,3808	4,5230
EUR/PLN	4,2818	0,29%	0,01%	4,3049	4,3284	4,3768

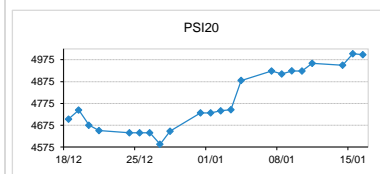

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1389	0,8859	123,91	1,1290	10,2512	7,4643	1,5107	1,58807	4,2555	9,7341
USD	0,8776	-	0,7775	108,815	0,9905	9,0041	6,5512	1,3249	1,3928	3,7348	8,5404

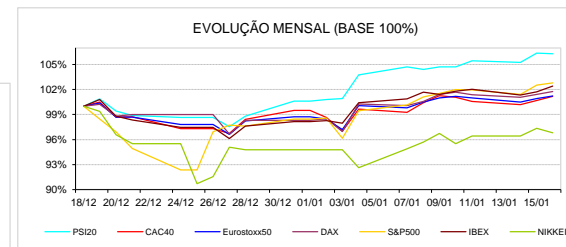
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	6,610	2,48	13,97
BCP	0,246	2,42	6,97
CORT. AMORIM	9,470	-0,53	5,22
CTT	3,058	0,26	3,80
EDP	3,064	-0,20	0,49
EDP R	7,860	-1,32	1,09
GALP	14,195	-2,34	2,90
IBERSOL	8,340	-2,80	5,57
J MARTINS	11,730	-0,26	13,44
MOTA ENGIL	1,724	-0,58	7,08
NAVIGATOR	3,966	0,15	10,17
NOS	5,445	0,46	2,83
NOVABASE	2,100	1,45	3,96
PHAROL	0,182	-1,73	11,40
REN	2,544	0,32	4,52
SEMAPA	14,620	0,14	11,60
SONAE CAP.	0,864	-0,80	1,77
SONAE SGPS	0,877	-0,68	8,21
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	2,48
BCP	2,42
NOVABASE	1,45
NOS	0,46
REN	0,32
SONAE CAP.	-0,80
EDP R	-1,32
PHAROL	-1,73
GALP	-2,34
IBERSOL	-2,80



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.998,62	-0,08%	5,65%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.810,74	0,51%	1,69%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.077,22	0,30%	2,53%	3.687,22	2.908,70
XTRA DAX	10.931,24	0,36%	3,53%	13.596,89	10.279,20
S&P 500	2.617,74	0,27%	4,41%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	8.912,70	0,71%	4,37%	10.643,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.442,75	-0,55%	2,14%	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.