

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

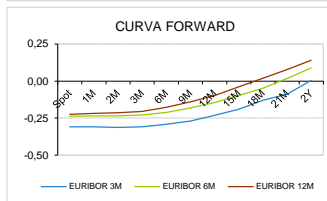
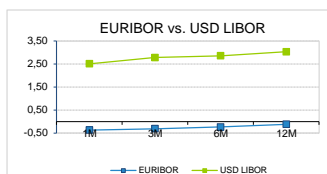
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

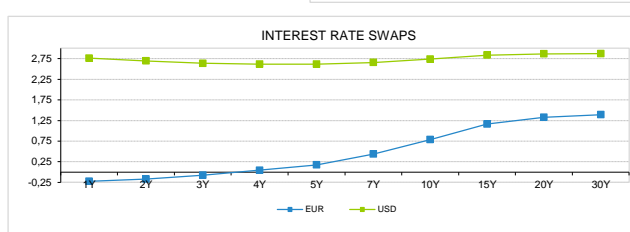
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,5133	1	6	0,7344	-0,7808
3M	-0,3080	0	0	3M	2,7803	1	-2	0,9236	-0,7028
6M	-0,2360	0	0	6M	2,8616	2	-4	1,0357	-0,6304
12M	-0,1180	0	1	12M	3,0301	2	-7	1,1811	-0,5016

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2248	0	0	-0,0960	0,4188	0,9900
2Y	-0,1700	0	-3	0,0219	0,5641	1,1155
3Y	-0,0750	0	-6	0,1529	0,7056	1,2295
4Y	0,0440	0	-8	0,2910	0,8379	1,3325
5Y	0,1740	1	-9	0,4300	0,9605	1,4230
7Y	0,4380	1	-9	0,6880	1,1710	1,5610
10Y	0,7860	1	-8	1,0010	1,3860	1,6865
15Y	1,1620	2	-5	1,2977	1,5562	1,7510
20Y	1,3280	2	-4	1,4219	1,6012	1,7230
30Y	1,3910	2	-3	1,4465	1,5600	1,6339

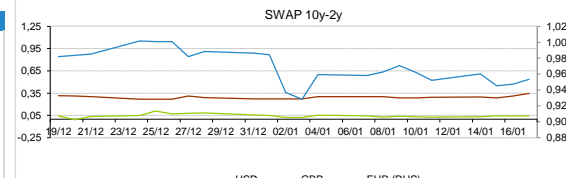
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



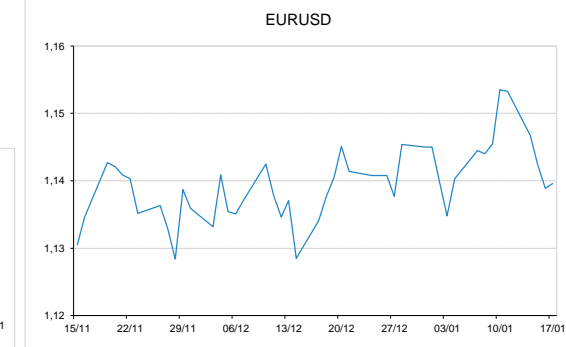
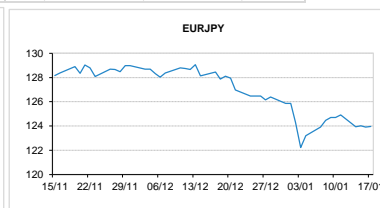
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7590	-1	-11	2,6802	2,5650	2,7285
2Y	2,6950	0	-19	2,5910	2,6030	2,7630
3Y	2,6360	0	-22	2,6060	2,6450	2,8050
4Y	2,6140	0	-23	2,6214	2,7049	2,8410
5Y	2,6170	0	-22	2,6240	2,7190	2,8987
7Y	2,6560	1	-21	2,7043	2,7900	2,9200
10Y	2,7390	1	-19	2,7942	2,8827	2,9759
15Y	2,8350	1	-16	2,8665	2,9231	2,9530
20Y	2,8660	2	-15	2,8873	2,9241	2,9572
30Y	2,8690	2	-14	2,8772	2,8954	2,9140



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	60,76	-0,56	1,10	OT 2Y	-0,145	-0,03	19,10
JETFUEL	604,50	-4,91	7,50	OT 5Y	0,575	-0,01	20,10
DIESEL	566,00	-5,91	11,75	OT 10Y	1,759	-0,03	12,40
COBRE	5.976,00	50,00	-161,50	BUND 10Y	-0,321	1,82	-7,30
ZINCO	2.510,50	41,00	-34,00	SCHATZ 2Y	0,034	0,92	-1,90
OURO	1.291,54	-2,33	44,72	T-NOTE 10Y	3,431	1,32	-7,80
TRIGO	513,25	0,75	-22,00	T-NOTE 2Y	2,903	1,95	-6,20
LICENÇA C02	23,66	0,26	-0,94	GILT 10Y	1,557	1,54	5,30


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1396	0,06%	0,49%	1,1485	1,1574	1,1761
EUR/GBP	0,8826	0,37%	1,85%	0,8854	0,8884	0,8951
EUR/JPY	123,95	-0,03%	3,62%	123,95	123,95	123,95
EUR/CHF	1,1319	-0,32%	-0,47%	1,1309	1,1297	1,1274
EUR/BRL	4,2792	-0,48%	3,50%	4,3373	4,4022	4,5417
EUR/PLN	4,2893	-0,20%	-0,16%	4,3130	4,3363	4,3842

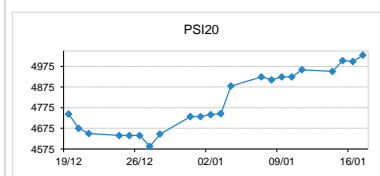

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1396	0,8826	123,95	1,1319	10,2746	7,4651	1,5131	1,5877	4,2792	9,7422
USD	0,8789	-	0,7748	109,015	0,9947	9,0367	6,5606	1,3294	1,3967	3,7646	8,5690

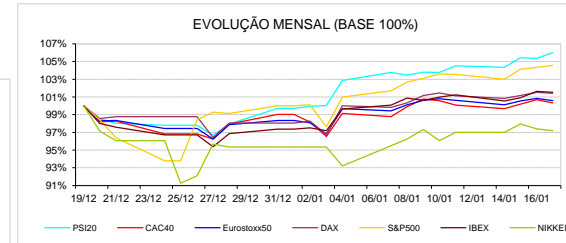
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	6,730	1,82	16,03
BCP	0,244	-0,73	6,19
CORT. AMORIM	9,550	0,84	6,11
CTT	3,040	-0,59	3,19
EDP	3,061	-0,10	0,39
EDP R	7,935	0,95	2,06
GALP	14,240	0,32	3,23
IBERSOL	8,400	0,72	6,33
J MARTINS	11,895	1,41	15,04
MOTA ENGIL	1,724	0,00	7,08
NAVIGATOR	4,126	4,03	14,61
NOS	5,450	0,09	2,93
NOVABASE	2,260	7,62	11,88
PHAROL	0,182	-0,11	11,27
REN	2,540	-0,16	4,35
SEMAPA	14,860	1,64	13,44
SONAE CAP.	0,864	0,00	1,77
SONAE SGPS	0,886	1,03	9,32

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOVABASE	7,62
NAVIGATOR	4,03
ALTRI	1,82
SEMAPA	1,64
J MARTINS	1,41
EDP	-0,10
PHAROL	-0,11
REN	-0,16
CTT	-0,59
BCP	-0,73



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.029,68	0,62%	6,30%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.794,37	-0,34%	1,35%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.069,09	-0,26%	2,25%	3.687,22	2.908,70
XTRA DAX	10.918,62	-0,12%	3,41%	13.596,89	10.279,20
S&P 500	2.621,64	0,21%	4,57%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	8.901,90	-0,12%	4,24%	10.643,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.402,27	-0,20%	1,94%	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.