

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

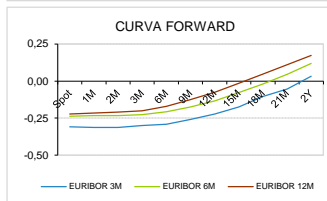
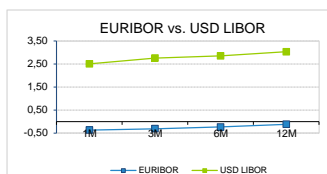
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

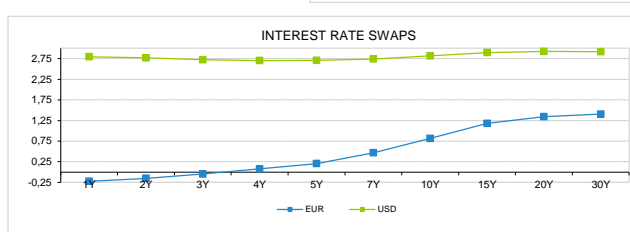
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,5060	0	4	0,7346	-0,7728
3M	-0,3080	0	0	3M	2,7610	-1	-3	0,9275	-0,7020
6M	-0,2360	0	0	6M	2,8519	0	-2	1,0344	-0,6418
12M	-0,1150	0	0	12M	3,0301	2	-3	1,1726	-0,5064

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2225	0	1	-0,0763	0,4480	0,9970
2Y	-0,1530	1	0	0,0473	0,5846	1,1198
3Y	-0,0470	2	-1	0,1801	0,7213	1,2351
4Y	0,0750	3	-3	0,3144	0,8506	1,3363
5Y	0,2060	3	-4	0,4491	0,9711	1,4185
7Y	0,4680	3	-4	0,7019	1,1777	1,5657
10Y	0,8130	3	-3	1,0100	1,3917	1,6951
15Y	1,1800	3	-2	1,3065	1,5638	1,7631
20Y	1,3440	3	-1	1,4319	1,6097	1,7350
30Y	1,4030	2	-1	1,4555	1,5716	1,6457

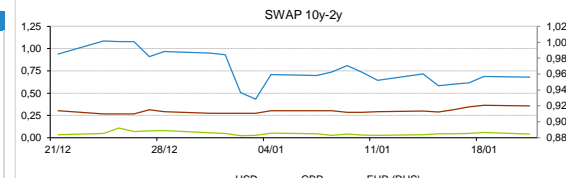
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



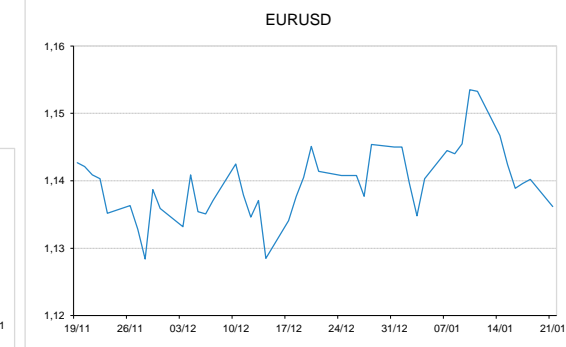
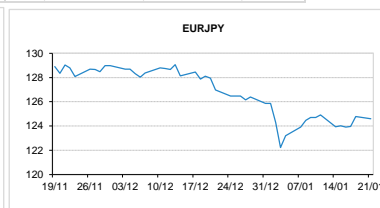
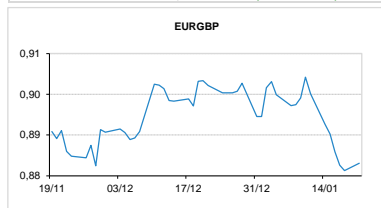
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7940	2	-2	2,7482	2,6880	2,8124
2Y	2,7670	4	-4	2,6833	2,7035	2,8439
3Y	2,7210	5	-5	2,6780	2,7417	2,8850
4Y	2,7030	6	-6	2,6757	2,7733	2,9308
5Y	2,7070	6	-6	2,7165	2,7939	2,9473
7Y	2,7410	5	-5	2,7601	2,8732	2,9961
10Y	2,8160	5	-5	2,8506	2,9329	3,0320
15Y	2,8980	5	-4	2,9217	2,9745	3,0246
20Y	2,9220	4	-4	2,9398	2,9747	3,0060
30Y	2,9160	4	-4	2,9249	2,9447	2,9619



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,67	-0,03	8,57	OT 2Y	-0,152	0,00	21,10
JETFUEL	619,25	2,75	60,07	OT 5Y	0,561	0,02	16,70
DIESEL	577,00	-0,75	56,82	OT 10Y	1,752	0,03	9,70
COBRE	6.056,00	60,00	82,00	BUND 10Y	-0,309	-0,73	-4,50
ZINCO	2.599,50	35,25	74,50	SCHATZ 2Y	0,041	0,00	-1,60
OURO	1.280,64	-2,04	23,46	T-NOTE 10Y	3,469	-0,66	-1,80
TRIGO	517,75	0,00	-15,00	T-NOTE 2Y	2,942	-0,98	-4,30
LICENÇA C02	24,35	-0,51	-0,57	GILT 10Y	1,548	-2,22	6,40


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1362	-0,35%	-0,46%	1,1450	1,1540	1,1730
EUR/GBP	0,88303	-0,20%	2,17%	0,8858	0,8888	0,8955
EUR/JPY	124,6	0,14%	1,91%	124,60	124,60	124,60
EUR/CHF	1,1339	-0,26%	-0,34%	1,1328	1,1318	1,1293
EUR/BRL	4,2769	-0,17%	3,65%	4,3361	4,4017	4,5424
EUR/PLN	4,2836	0,11%	0,17%	4,3069	4,3306	4,3794

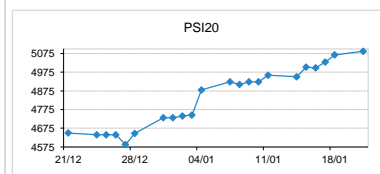

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1362	0,8830	124,60	1,1339	10,2468	7,4663	1,5111	1,58854	4,2769	9,7414
USD	0,8799	-	0,7759	109,625	0,9977	9,0222	6,5698	1,3290	1,3979	3,7702	8,5712

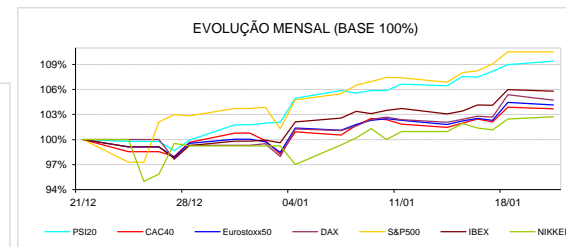
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	6,940	0,14	19,66
BCP	0,243	0,16	5,93
CORT. AMORIM	9,660	-0,10	7,33
CTT	3,096	1,04	5,09
EDP	3,043	-1,04	-0,20
EDP R	7,960	0,13	2,38
GALP	14,375	0,10	4,20
IBERSOL	8,760	1,62	10,89
J MARTINS	12,550	3,72	21,37
MOTA ENGIL	1,774	0,23	10,19
NAVIGATOR	4,120	-0,72	14,44
NOS	5,480	-0,27	3,49
NOVABASE	2,290	-1,29	13,37
PHAROL	0,182	-0,55	11,76
REN	2,542	-0,16	4,44
SEMAPA	15,260	0,93	16,49
SONAE CAP.	0,875	1,04	3,06
SONAE SGPS	0,909	2,02	12,16

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
J MARTINS	3,72
SONAE SGPS	2,02
IBERSOL	1,62
CTT	1,04
SONAE CAP.	1,04
NOS	-0,27
PHAROL	-0,55
NAVIGATOR	-0,72
EDP	-1,04
NOVABASE	-1,29



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.087,36	0,38%	7,52%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.867,78	-0,17%	2,90%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.125,07	-0,31%	4,12%	3.687,22	2.908,70
XTRA DAX	11.136,20	-0,62%	5,47%	13.596,89	10.279,20
S&P 500	2.670,71	1,32%	6,54%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.053,80	-0,17%	6,02%	10.643,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.719,33	0,26%	3,52%	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.