

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

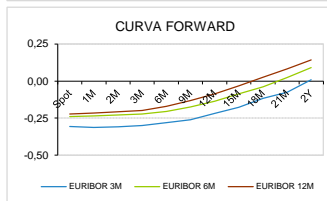
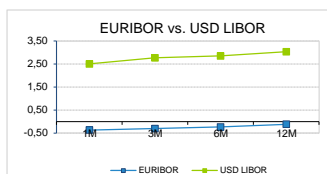
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

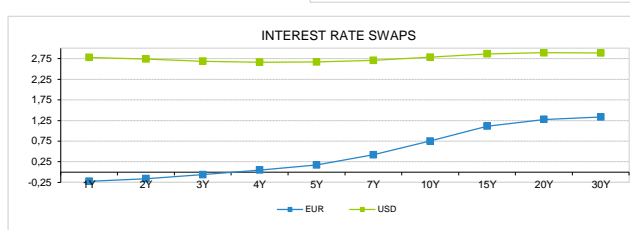
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,5019	-1	0	0,7326	-0,7808
3M	-0,3070	0	0	3M	2,7648	-1	-5	0,9256	-0,7010
6M	-0,2370	0	0	6M	2,8501	0	-4	1,0431	-0,6456
12M	-0,1140	0	0	12M	3,0291	-1	-2	1,1699	-0,5098

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2222	0	1	-0,0953	0,3685	0,9046
2Y	-0,1580	0	0	0,0262	0,5116	1,0170
3Y	-0,0630	-1	-2	0,1472	0,6427	1,1280
4Y	0,0500	-1	-4	0,2728	0,7655	1,2250
5Y	0,1710	-2	-6	0,3978	0,8813	1,3100
7Y	0,4190	-2	-8	0,6346	1,0790	1,4470
10Y	0,7500	-3	-8	0,9284	1,2908	1,5720
15Y	1,1130	-3	-7	1,2160	1,4605	1,6390
20Y	1,2770	-3	-6	1,3340	1,4993	1,6112
30Y	1,3360	-3	-5	1,3524	1,4570	1,5244

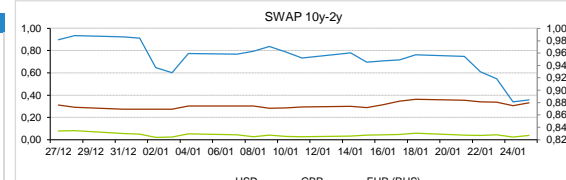
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



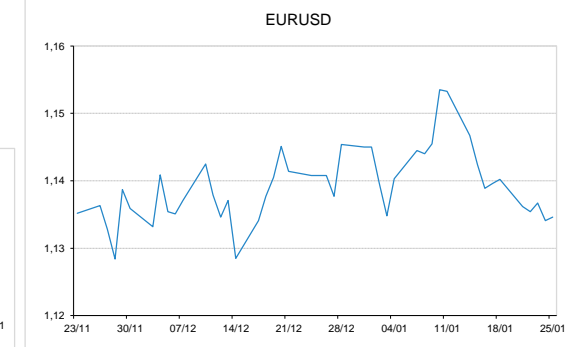
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7800	0	-7	2,6990	2,5819	2,7320
2Y	2,7400	0	-8	2,6371	2,6100	2,7700
3Y	2,6880	0	-8	2,5960	2,6430	2,8035
4Y	2,6650	-1	-7	2,5970	2,6890	2,8490
5Y	2,6680	-1	-9	2,6290	2,7255	2,9013
7Y	2,7050	-1	-8	2,6915	2,7990	2,9240
10Y	2,7820	0	-6	2,8014	2,8842	2,9520
15Y	2,8660	-1	-5	2,8520	2,9228	2,9570
20Y	2,8910	-1	-4	2,8720	2,9050	2,9380
30Y	2,8870	-1	-3	2,8580	2,8765	2,8945



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	61,48	0,39	10,71	OT 2Y	-0,181	0,01	16,70
JETFUEL	607,34	1,09	51,59	OT 5Y	0,483	0,01	7,10
DIESEL	572,34	1,43	55,91	OT 10Y	1,649	0,00	-3,80
COBRE	5.915,00	-29,50	-33,50	BUND 10Y	-0,378	1,45	-12,90
ZINCO	2.658,50	19,50	174,50	SCHATZ 2Y	0,044	0,46	-0,40
OURO	1.297,42	17,03	29,07	T-NOTE 10Y	3,442	2,81	-4,80
TRIGO	521,50	0,00	5,00	T-NOTE 2Y	2,926	2,54	1,60
LICENÇA C02	23,93	-0,14	-1,25	GILT 10Y	1,527	3,17	4,90


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1346	0,04%	-0,54%	1,1434	1,1524	1,1714
EUR/GBP	0,8658	0,58%	3,99%	0,8685	0,8715	0,8781
EUR/JPY	124,72	-0,23%	1,40%	124,72	124,72	124,72
EUR/CHF	1,1328	-0,55%	-0,61%	1,1318	1,1306	1,1283
EUR/BRL	4,3004	-0,92%	3,51%	4,3597	4,4242	4,5580
EUR/PLN	4,2865	0,14%	0,03%	4,3082	4,3310	4,3783

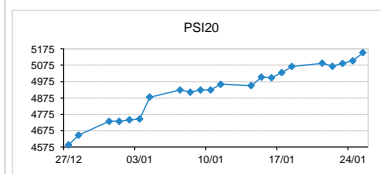

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1346	0,8658	124,72	1,1328	10,3292	7,4658	1,5120	1,59059	4,3004	9,7188
USD	0,8773	-	0,7595	109,665	0,9933	9,0435	6,5501	1,3256	1,3954	3,7581	8,5162

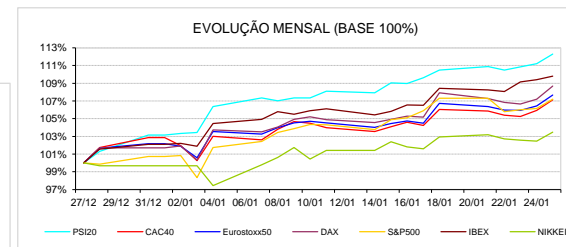
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,140	1,85	23,10
BCP	0,244	1,04	6,32
CORT. AMORIM	9,760	1,88	8,44
CTT	3,162	0,83	7,33
EDP	3,095	1,38	1,51
EDP R	7,850	-0,44	0,96
GALP	13,950	-0,14	1,12
IBERSOL	8,500	0,00	7,59
J MARTINS	12,720	1,52	23,02
MOTA ENGIL	2,035	3,51	26,40
NAVIGATOR	4,240	2,27	17,78
NOS	5,710	1,06	7,84
NOVABASE	2,300	0,44	13,86
PHAROL	0,179	-0,11	9,93
REN	2,570	0,63	5,59
SEMAPA	15,220	0,79	16,18
SONAE CAP.	0,878	0,57	3,42
SONAE SGPS	0,951	0,26	17,41

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	3,51
NAVIGATOR	2,27
CORT. AMORIM	1,88
ALTRI	1,85
J MARTINS	1,52
PHAROL	-0,11
GALP	-0,14
EDP R	-0,44



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.152,04	0,99%	8,89%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.925,82	1,11%	4,12%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.163,24	1,18%	5,39%	3.659,33	2.908,70
XTRA DAX	11.281,79	1,36%	6,85%	13.443,36	10.279,20
S&P 500	2.668,18	0,98%	6,44%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.185,20	0,38%	7,56%	10.635,10	8.286,20
NIKKEI 225	20.773,56	0,97%	3,79%	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.