

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

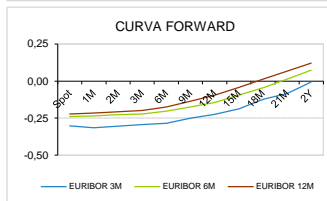
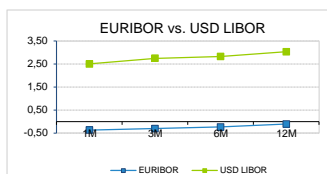
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

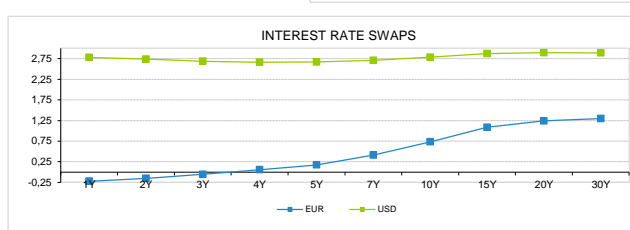
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,5018	0	-2	0,7331	-0,7804
3M	-0,3060	0	0	3M	2,7505	0	-5	0,9230	-0,7004
6M	-0,2370	0	0	6M	2,8299	0	-4	1,0416	-0,6412
12M	-0,1090	0	1	12M	3,0300	0	2	1,1724	-0,5076

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,2210	0	1	-0,0964	0,3753	0,8901	
2Y	-0,1530	1	2	0,0124	0,5025	1,0078	
3Y	-0,0550	1	1	0,1330	0,6306	1,1215	
4Y	0,0570	1	-1	0,2565	0,7529	1,2226	
5Y	0,1750	2	-3	0,3816	0,8702	1,3102	
7Y	0,4130	1	-6	0,6200	1,0731	1,4485	
10Y	0,7330	1	-8	0,9190	1,2817	1,5774	
15Y	1,0840	1	-9	1,2088	1,4542	1,6497	
20Y	1,2410	1	-9	1,3339	1,5026	1,6243	
30Y	1,2960	1	-8	1,3580	1,4620	1,5366	

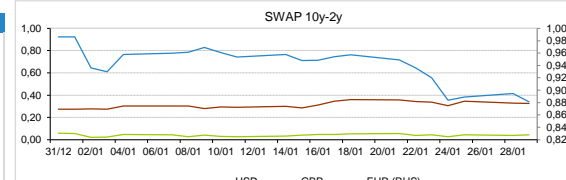
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7780	1	-7	2,6712	2,5420	2,7085
2Y	2,7390	2	0	2,5830	2,5825	2,7445
3Y	2,6880	3	-8	2,5680	2,6185	2,8130
4Y	2,6640	3	-8	2,5775	2,6650	2,8280
5Y	2,6690	4	-9	2,6025	2,7015	2,8863
7Y	2,7060	4	-7	2,6680	2,7770	2,9150
10Y	2,7830	4	-6	2,7819	2,8540	2,9490
15Y	2,8690	3	-4	2,8390	2,8950	2,9500
20Y	2,8940	3	-4	2,8828	2,8960	2,9290
30Y	2,8900	3	-3	2,8540	2,8996	2,8980

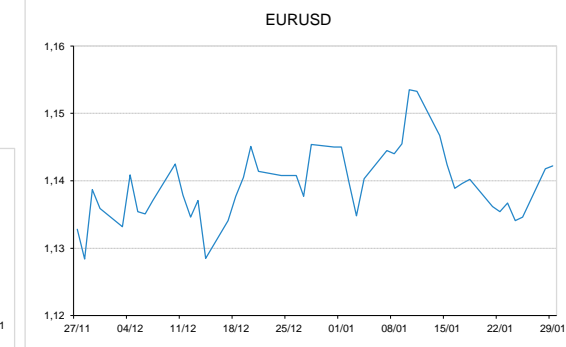
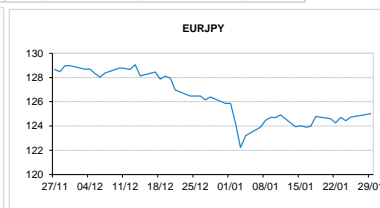
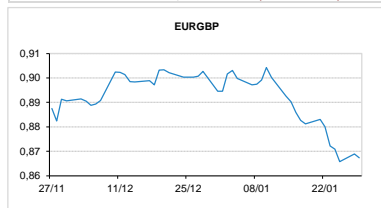


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	61,42	1,49	8,21	OT 2Y	-0,170	0,01	17,10
JETFUEL	613,75	18,25	75,75	OT 5Y	0,474	0,01	1,50
DIESEL	576,75	18,25	79,25	OT 10Y	1,668	0,02	-5,40
COBRE	5.989,00	-54,00	5,00	BUND 10Y	-0,372	-1,01	-10,90
ZINCO	2.698,50	7,00	248,50	SCHATZ 2Y	0,050	0,92	2,20
OURO	1.309,66	6,34	30,67	T-NOTE 10Y	3,421	-1,98	-0,60
TRIGO	513,25	-5,50	1,75	T-NOTE 2Y	2,916	-1,56	6,80
LICENÇA C02	23,41	0,64	-1,57	GILT 10Y	1,498	-0,38	1,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1422	0,04%	-0,24%	1,1510	1,1601	1,1790
EUR/GBP	0,86735	0,18%	3,13%	0,8700	0,8730	0,8795
EUR/JPY	125,03	-0,07%	0,66%	125,03	125,03	125,03
EUR/CHF	1,1369	-0,31%	-1,00%	1,1358	1,1347	1,1323
EUR/BRL	4,2612	0,99%	4,33%	4,3186	4,3831	4,5155
EUR/PLN	4,2957	-0,05%	-0,15%	4,3175	4,3405	4,3874



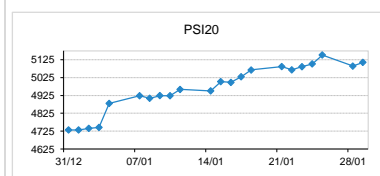
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1422	0,8674	125,03	1,1369	10,3636	7,4649	1,5154	1,59811	4,2612	9,7142
USD	0,8761	-	0,7606	109,325	0,9949	9,0777	6,5399	1,3271	1,3990	3,7301	8,5106

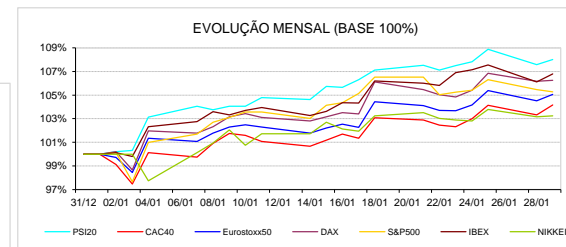
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,070	1,00	21,90
BCP	0,244	0,33	6,32
CORT. AMORIM	9,730	1,46	8,11
CTT	3,130	0,71	6,25
EDP	3,136	1,55	2,85
EDP R	7,850	0,00	0,96
GALP	13,610	0,52	-1,34
IBERSOL	8,480	0,95	7,34
J MARTINS	12,500	-0,36	20,89
MOTA ENIGL	1,900	-2,66	18,01
NAVIGATOR	4,198	1,30	16,61
NOS	5,650	-0,53	6,70
NOVABASE	2,220	-1,77	9,90
PHAROL	0,183	1,78	12,25
REN	2,620	1,71	7,64
SEMAPA	14,860	-0,27	13,44
SONAE CAP.	0,871	-0,91	2,59
SONAE SGPS	0,913	-1,83	12,65

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	1,78
REN	1,71
EDP	1,55
CORT. AMORIM	1,46
NAVIGATOR	1,30
NOS	-0,53
SONAE CAP.	-0,91
NOVABASE	-1,77
SONAE SGPS	-1,83
MOTA ENIGL	-2,66



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.110,44	0,40%	8,01%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.928,18	0,81%	4,17%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.153,42	0,51%	5,06%	3.651,21	2.908,70
XTRA DAX	11.218,83	0,08%	6,25%	13.370,02	10.279,20
S&P 500	2.639,46	-0,17%	5,29%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.119,10	0,63%	6,78%	10.605,70	8.286,20
NIKKEI 225	20.664,64	0,08%	3,25%	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.