

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

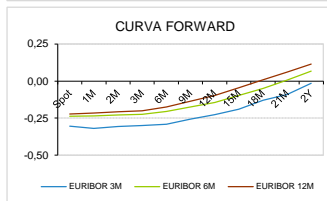
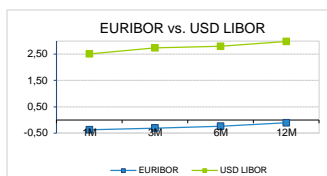
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

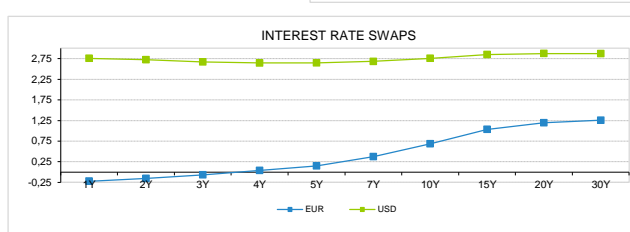
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	-1	1M	2,5138	0	1	0,7308	-0,7882
3M	-0,3080	0	0	3M	2,7375	0	-7	0,9120	-0,7130
6M	-0,2350	0	0	6M	2,7995	-1	-8	1,0270	-0,6526
12M	-0,1100	0	1	12M	2,9835	-4	-2	1,1669	-0,5162

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2210	0	1	-0,0970	0,3539	0,8514
2Y	-0,1560	0	2	0,0097	0,4773	0,9690
3Y	-0,0660	0	0	0,1236	0,6014	1,0815
4Y	0,0390	-1	-2	0,2417	0,7223	1,1819
5Y	0,1500	-1	-5	0,3621	0,8375	1,2700
7Y	0,3750	-2	-10	0,5955	1,0382	1,4115
10Y	0,6860	-3	-13	0,8905	1,2506	1,5465
15Y	1,0360	-4	-14	1,1837	1,4274	1,6226
20Y	1,1960	-4	-13	1,3108	1,4779	1,6003
30Y	1,2540	-4	-13	1,3371	1,4409	1,5095

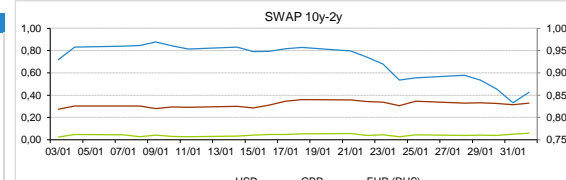
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7560	-1	0	2,6052	2,5210	2,6820
2Y	2,7220	1	5	2,5280	2,5610	2,7220
3Y	2,6680	1	4	2,5478	2,6010	2,7580
4Y	2,6430	1	-10	2,5450	2,6390	2,7875
5Y	2,6450	1	1	2,5907	2,6665	2,8512
7Y	2,6810	1	0	2,6250	2,7470	2,8790
10Y	2,7570	1	-1	2,7220	2,8210	2,9120
15Y	2,8460	1	-1	2,8235	2,8848	2,9190
20Y	2,8730	0	-1	2,8280	2,8887	2,9265
30Y	2,8710	0	-1	2,8436	2,8681	2,8550

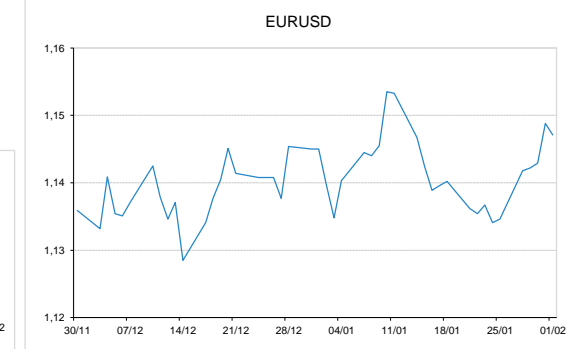


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	61,97	1,13	7,95	OT 2Y	-0,204	0,00	14,30
JETFUEL	621,50	2,00	65,07	OT 5Y	0,453	0,03	-0,10
DIESEL	585,75	2,50	70,07	OT 10Y	1,641	0,02	-7,20
COBRE	6.163,50	33,00	204,00	BUND 10Y	-0,404	1,37	-6,10
ZINCO	2.738,50	36,00	263,00	SCHATZ 2Y	0,041	-1,61	2,50
OURO	1.317,06	-5,01	35,48	T-NOTE 10Y	3,395	5,58	2,70
TRIGO	522,25	5,75	19,00	T-NOTE 2Y	2,862	5,26	3,40
LICENÇA C02	22,01	-0,29	-3,00	GILT 10Y	1,484	2,20	4,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1471	-0,15%	0,18%	1,1560	1,1650	1,1837
EUR/GBP	0,8788	-0,35%	1,78%	0,8817	0,8846	0,8910
EUR/JPY	124,91	-0,08%	0,75%	124,91	124,91	124,91
EUR/CHF	1,1401	-0,21%	-1,22%	1,1390	1,1379	1,1355
EUR/BRL	4,1934	-0,44%	6,05%	4,2499	4,3134	4,4448
EUR/PLN	4,2905	-0,66%	0,20%	4,3120	4,3344	4,3807



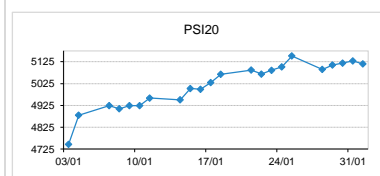
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1471	0,8789	124,91	1,1401	10,3715	7,4659	1,5019	1,57989	4,1934	9,6745
USD	0,8721	-	0,7637	109,375	0,9944	9,0388	6,5112	1,3098	1,3779	3,6500	8,4349

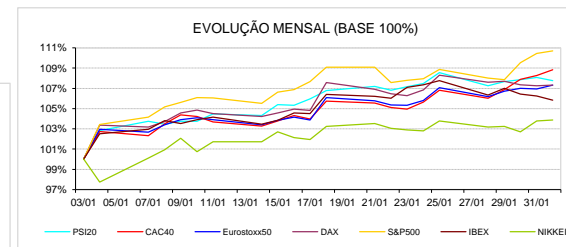
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,140	-1,24	23,10
BCP	0,233	-3,32	1,53
CORT. AMORIM	9,770	0,21	8,56
CTT	3,130	-0,51	6,25
EDP	3,190	0,00	4,62
EDP R	7,855	0,06	1,03
GALP	13,670	0,18	-0,91
IBERSOL	8,300	-1,43	5,06
J MARTINS	12,380	0,08	19,73
MOTA ENGIL	1,930	0,00	19,88
NAVIGATOR	4,282	0,19	18,94
NOS	5,730	1,15	8,22
NOVABASE	2,190	0,92	8,42
PHAROL	0,182	0,33	11,27
REN	2,600	-0,84	6,82
SEMAPA	15,080	-1,18	15,11
SONAE CAP.	0,882	-0,79	3,89
SONAE SGPS	0,926	1,54	14,26

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE SGPS	1,54
NOS	1,15
NOVABASE	0,92
PHAROL	0,33
CORT. AMORIM	0,21
REN	-0,84
SEMAPA	-1,18
ALTRI	-1,24
IBERSOL	-1,43
BCP	-3,32



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.115,02	-0,27%	8,11%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.019,26	0,53%	6,10%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.171,12	0,37%	5,65%	3.636,22	2.908,70
XTRA DAX	11.180,66	0,07%	5,89%	13.301,41	10.279,20
S&P 500	2.711,20	0,23%	8,12%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.019,40	-0,41%	5,61%	10.543,70	8.286,20
NIKKEI 225	20.788,39	0,07%	3,87%	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.