

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

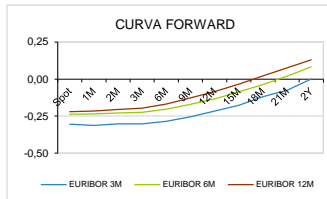
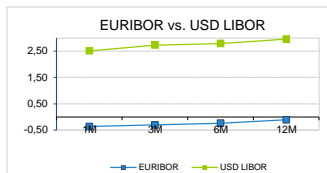
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

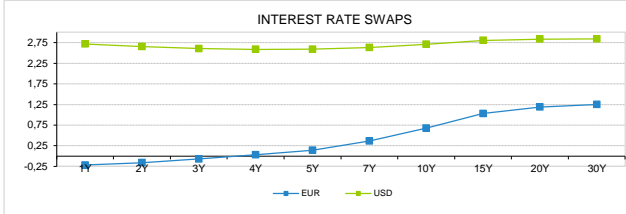
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,5140	0	1	0,7306
3M	-0,3070	0	0	3M	2,7326	0	-8	0,9135
6M	-0,2350	0	0	6M	2,7900	-1	-9	1,0303
12M	-0,1090	0	1	12M	2,9616	-2	-4	1,1695

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2195	0	1	-0,0863	0,3670	0,8604
2Y	-0,1590	0	2	0,0224	0,4871	0,9762
3Y	-0,0700	0	0	0,1365	0,6108	1,0878
4Y	0,0310	-1	-3	0,2534	0,7305	1,1875
5Y	0,1400	-1	-6	0,3734	0,8445	1,2710
7Y	0,3650	-1	-11	0,6059	1,0443	1,4157
10Y	0,6780	-1	-14	0,8991	1,2549	1,5478
15Y	1,0290	-1	-14	1,1881	1,4302	1,6247
20Y	1,1910	-1	-14	1,3143	1,4788	1,5988
30Y	1,2500	0	-13	1,3381	1,4413	1,5104

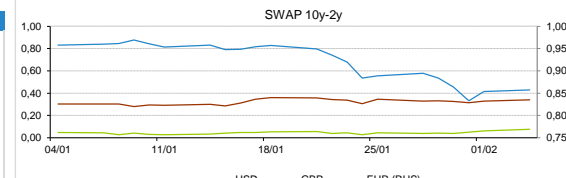
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



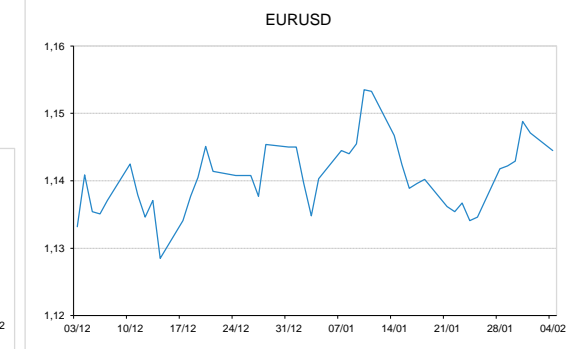
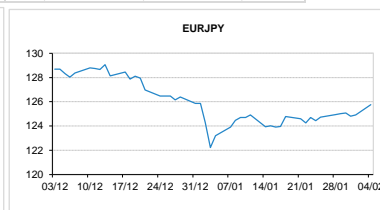
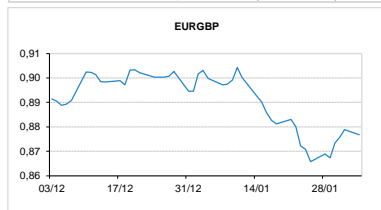
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7170	1	-5	2,6313	2,5340	2,7195
2Y	2,6550	3	-3	2,5540	2,5910	2,7846
3Y	2,6040	4	-1	2,5520	2,6578	2,8224
4Y	2,5870	4	-15	2,5525	2,6755	2,8340
5Y	2,5900	4	-5	2,6255	2,7130	2,8946
7Y	2,6300	4	-5	2,6640	2,7700	2,9426
10Y	2,7100	4	-6	2,7585	2,8590	2,9510
15Y	2,8050	3	-5	2,8380	2,9010	2,9570
20Y	2,8350	3	-4	2,8620	2,9030	2,9613
30Y	2,8380	3	-1	2,8530	2,8998	2,8930



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,16	-0,59	4,95	OT 2Y	-0,204	0,00	7,70
JETFUEL	615,22	-10,17	38,57	OT 5Y	0,471	0,02	-4,00
DIESEL	580,22	-10,17	44,82	OT 10Y	1,659	0,02	-10,80
COBRE	6.141,50	-30,00	174,00	BUND 10Y	-0,389	1,59	-3,30
ZINCO	2.797,50	59,00	322,00	SCHATZ 2Y	0,053	1,38	4,40
OURO	1.314,68	-3,03	30,21	T-NOTE 10Y	3,419	2,47	15,20
TRIGO	526,25	2,00	9,25	T-NOTE 2Y	2,879	2,14	17,10
LICENÇA C02	22,85	0,86	-0,88	GILT 10Y	1,507	2,59	9,10


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1445	-0,23%	0,37%	1,1533	1,1624	1,1810
EUR/GBP	0,8768	0,24%	2,63%	0,8795	0,8825	0,8890
EUR/JPY	125,77	-0,68%	-2,04%	125,77	125,77	125,77
EUR/CHF	1,1407	-0,02%	-1,44%	1,1396	1,1384	1,1361
EUR/BRL	4,1974	-0,11%	0,93%	4,2543	4,3205	4,4518
EUR/PLN	4,2875	0,06%	0,10%	4,3081	4,3305	4,3762

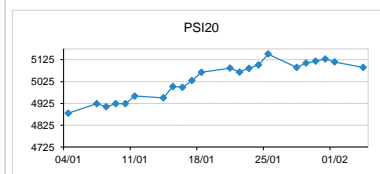

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1445	0,8768	125,77	1,1407	10,4055	7,4652	1,5006	1,58398	4,1974	9,6872
USD	0,8750	-	0,7642	110,04	0,9980	9,1134	6,5327	1,3125	1,3853	3,6634	8,4754

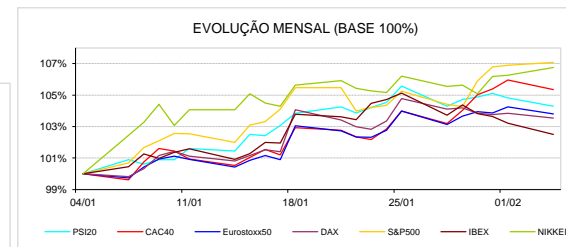
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,160	0,28	23,45
BCP	0,230	-1,16	0,35
CORT. AMORIM	9,640	-1,33	7,11
CTT	3,106	-0,77	5,43
EDP	3,190	0,00	4,62
EDP R	7,830	-0,32	0,71
GALP	13,830	1,17	0,25
IBERSOL	8,360	0,72	5,82
J MARTINS	12,485	0,75	20,74
MOTA ENGIL	1,924	-0,31	19,50
NAVIGATOR	4,198	-1,96	16,61
NOS	5,630	-1,75	6,33
NOVABASE	2,230	1,83	10,40
PHAROL	0,178	-2,09	8,95
REN	2,584	-0,62	6,16
SEMAPA	14,840	-1,59	13,28
SONAE CAP.	0,898	1,81	5,77
SONAE SGPS	0,910	-1,73	12,28

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOVABASE	1,83
SONAE CAP.	1,81
GALP	1,17
J MARTINS	0,75
IBERSOL	0,72
SEMAPA	-1,59
SONAE SGPS	-1,73
NOS	-1,75
NAVIGATOR	-1,96
PHAROL	-2,09



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.089,83	-0,49%	7,57%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.990,59	-0,57%	5,49%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.157,77	-0,42%	5,21%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.149,06	-0,28%	5,59%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.711,92	0,19%	8,17%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	8.956,20	-0,70%	4,87%	10.369,20	8.286,20
NIKKEI 225	20.883,77	0,46%	4,34%	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.