

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

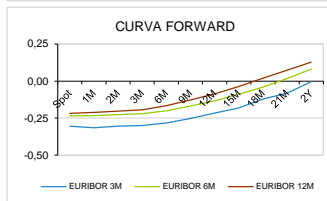
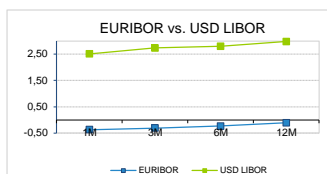
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

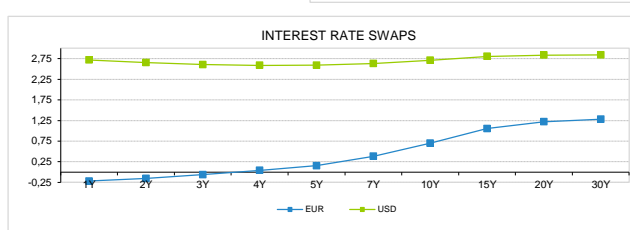
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	-1	1M	2,5131	0	-1	0,7301	-0,7840
3M	-0,3080	0	0	3M	2,7344	0	-7	0,9168	-0,7032
6M	-0,2340	0	0	6M	2,7958	1	-6	1,0336	-0,6498
12M	-0,1090	0	1	12M	2,9801	2	2	1,1766	-0,5140

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,2180	0	1	-0,0873	0,4118	0,8480	
2Y	-0,1540	1	2	0,0196	0,4558	0,9680	
3Y	-0,0620	1	2	0,1326	0,6020	1,0804	
4Y	0,0420	1	1	0,2490	0,7111	1,1811	
5Y	0,1540	1	-1	0,3680	0,8285	1,2680	
7Y	0,3840	2	-4	0,5997	1,0312	1,4100	
10Y	0,6990	2	-7	0,8924	1,2467	1,5444	
15Y	1,0550	3	-8	1,1842	1,4243	1,6187	
20Y	1,2190	3	-7	1,3092	1,4737	1,5946	
30Y	1,2800	3	-7	1,3307	1,4345	1,5035	

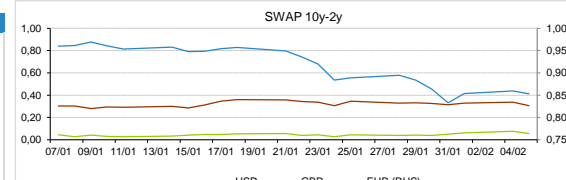
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



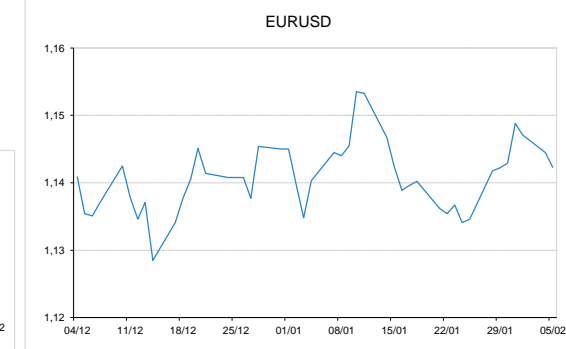
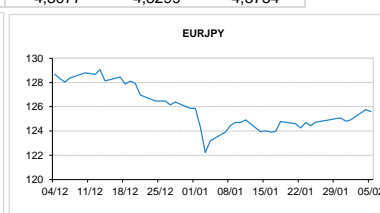
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7170	1	-5	2,6297	2,5090	2,7269
2Y	2,6550	3	-3	2,5260	2,5879	2,7070
3Y	2,6040	4	-1	2,5210	2,5875	2,7621
4Y	2,5870	4	-15	2,5380	2,6470	2,8100
5Y	2,5900	4	-5	2,5780	2,6655	2,8684
7Y	2,6300	4	-5	2,6250	2,7370	2,8750
10Y	2,7100	4	-6	2,7597	2,8150	2,9080
15Y	2,8050	3	-5	2,7980	2,8580	2,9160
20Y	2,8350	3	-4	2,8225	2,8620	2,9378
30Y	2,8380	3	-1	2,8548	2,8350	2,8545



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,28	-0,23	5,07	OT 2Y	-0,208	0,00	5,10
JETFUEL	617,24	2,02	40,59	OT 5Y	0,467	0,00	-7,40
DIESEL	582,99	2,77	47,59	OT 10Y	1,664	0,01	-14,40
COBRE	6.184,50	29,00	250,00	BUND 10Y	-0,403	-1,37	-10,90
ZINCO	2.818,00	20,50	368,00	SCHATZ 2Y	0,053	0,23	2,30
OURO	1.313,47	-1,01	29,00	T-NOTE 10Y	3,403	-1,48	4,60
TRIGO	525,00	-0,75	8,00	T-NOTE 2Y	2,881	0,00	7,20
LICENÇA C02	23,17	0,11	-0,56	GILT 10Y	1,462	-4,59	-3,60


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1423	-0,19%	-0,19%	1,1510	1,1601	1,1787
EUR/GBP	0,87803	-0,14%	2,18%	0,8808	0,8837	0,8902
EUR/JPY	125,59	0,14%	-1,35%	125,59	125,59	125,59
EUR/CHF	1,1411	-0,02%	-1,44%	1,1400	1,1388	1,1364
EUR/BRL	4,197	-0,15%	2,10%	4,2535	4,3193	4,4480
EUR/PLN	4,2872	0,00%	0,20%	4,3077	4,3299	4,3754

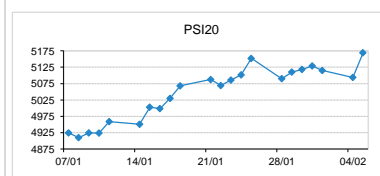

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1423	0,8780	125,59	1,1411	10,3934	7,4653	1,4977	1,57692	4,1970	9,6768
USD	0,8765	-	0,7728	109,895	1,0000	9,1090	6,5429	1,3130	1,3820	3,6789	8,4786

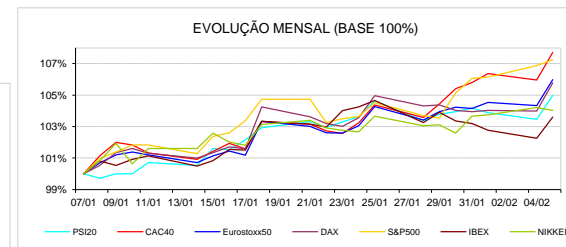
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,230	0,84	24,66
BCP	0,236	2,39	2,61
CORT. AMORIM	9,660	0,10	7,33
CTT	3,130	0,64	6,25
EDP	3,219	0,69	5,58
EDP R	7,850	0,00	0,96
GALP	14,325	3,35	3,84
IBERSOL	8,180	-2,15	3,54
J MARTINS	13,010	4,46	25,82
MOTA ENGIL	1,942	1,15	20,62
NAVIGATOR	4,264	1,38	18,44
NOS	5,620	-0,09	6,14
NOVABASE	2,220	-0,45	9,90
PHAROL	0,179	1,13	9,80
REN	2,602	0,31	6,90
SEMAPA	15,120	1,61	15,42
SONAE CAP.	0,898	0,00	5,77
SONAE SGPS	0,911	0,05	12,41

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
J MARTINS	4,46
GALP	3,35
BCP	2,39
SEMAPA	1,61
NAVIGATOR	1,38
NOS	-0,09
NOVABASE	-0,45
IBERSOL	-2,15



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.169,42	1,48%	9,26%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.083,34	1,66%	7,45%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.215,04	1,57%	7,12%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.367,98	1,71%	7,66%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.732,90	0,34%	9,07%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.092,00	1,30%	6,46%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.844,45	-0,19%	4,15%	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.