

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

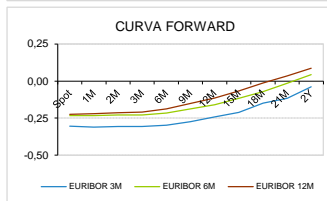
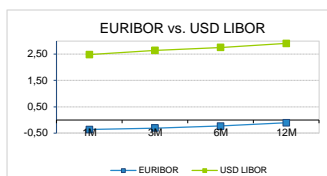
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

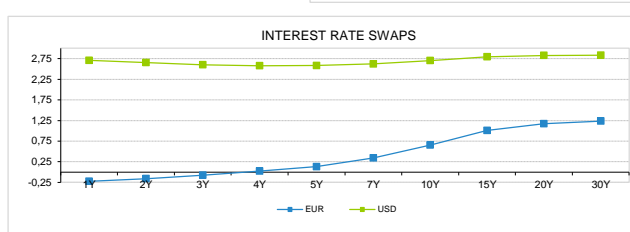
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4848	0	-2	0,7293	-0,7782
3M	-0,3080	0	0	3M	2,6436	-4	-12	0,8688	-0,7172
6M	-0,2320	0	0	6M	2,7554	0	-10	0,9880	-0,6518
12M	-0,1080	0	1	12M	2,9071	0	-12	1,1258	-0,5194

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2240	0	0	-0,1161	0,3164	0,7705
2Y	-0,1590	0	-1	-0,0147	0,4305	0,8790
3Y	-0,0740	-1	-3	0,0956	0,5431	0,9890
4Y	0,0250	-1	-5	0,2074	0,6520	1,0920
5Y	0,1300	0	-8	0,3188	0,7620	1,1840
7Y	0,3440	0	-12	0,5387	0,9640	1,3420
10Y	0,6530	0	-16	0,8323	1,1880	1,4770
15Y	1,0090	0	-17	1,1313	1,3705	1,5610
20Y	1,1720	0	-17	1,2617	1,4274	1,5460
30Y	1,2350	0	-17	1,2958	1,3966	1,4650

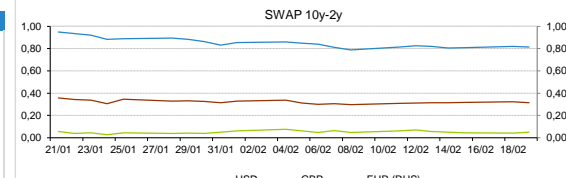
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



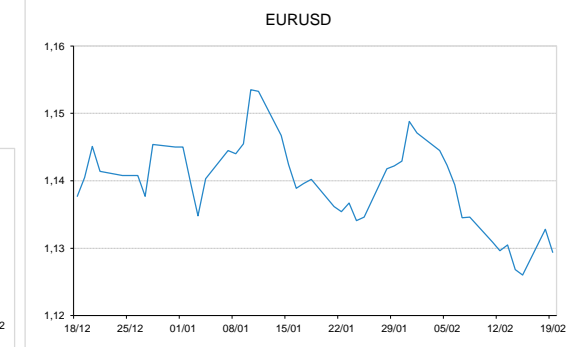
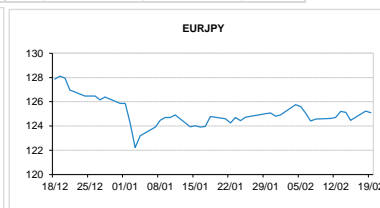
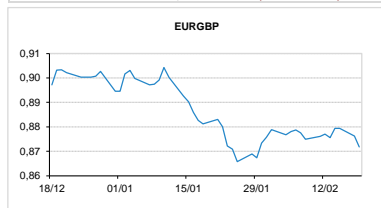
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7070	0	-5	2,5725	2,4753	2,6195
2Y	2,6530	2	-4	2,4855	2,4900	2,6919
3Y	2,6000	2	-4	2,4780	2,5469	2,7020
4Y	2,5790	2	-4	2,5115	2,6000	2,7689
5Y	2,5830	2	-3	2,5375	2,6410	2,8075
7Y	2,6210	2	-4	2,6015	2,7172	2,8639
10Y	2,7020	2	-4	2,6775	2,7700	2,8988
15Y	2,7960	1	-4	2,7640	2,8465	2,8850
20Y	2,8280	1	-4	2,7890	2,8541	2,8970
30Y	2,8310	1	-4	2,7880	2,8130	2,8350



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	66,18	-0,32	3,59	OT 2Y	-0,237	0,00	-8,20
JETFUEL	646,75	-4,50	30,25	OT 5Y	0,351	0,02	-19,40
DIESEL	615,25	-6,75	37,50	OT 10Y	1,507	-0,01	-22,00
COBRE	6.261,00	87,00	223,00	BUND 10Y	-0,473	-0,57	-17,20
ZINCO	2.658,50	-1,50	67,50	SCHATZ 2Y	0,053	-0,23	1,20
OURO	1.338,25	11,65	55,57	T-NOTE 10Y	3,363	-1,97	-11,20
TRIGO	497,25	-9,75	-26,25	T-NOTE 2Y	2,867	-1,75	-8,40
LICENÇA C02	20,21	0,20	-4,65	GILT 10Y	1,414	0,38	-15,70


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1294	-0,30%	-0,60%	1,1380	1,1469	1,1653
EUR/GBP	0,87185	0,50%	1,28%	0,8745	0,8774	0,8837
EUR/JPY	125,09	0,11%	-0,39%	125,09	125,09	125,09
EUR/CHF	1,1347	0,11%	-0,06%	1,1336	1,1325	1,1301
EUR/BRL	4,2132	0,35%	1,48%	4,2718	4,3378	4,4677
EUR/PLN	4,3324	-0,05%	-1,15%	4,3535	4,3757	4,4208

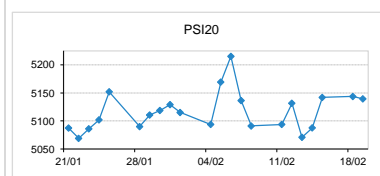

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1294	0,8719	125,09	1,1347	10,5584	7,4616	1,5007	1,58521	4,2132	9,7244
USD	0,8823	-	0,7674	110,555	1,0015	9,3341	6,5829	1,3261	1,4004	3,7106	8,5934

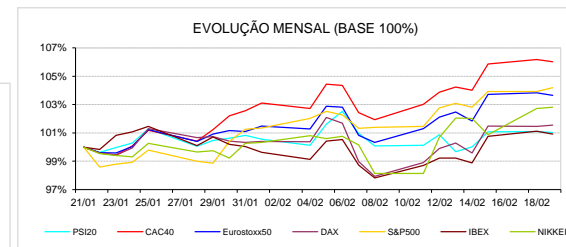
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,210	-0,96	24,31
BCP	0,231	-0,56	0,65
CORT. AMORIM	9,590	-1,84	6,56
CTT	3,072	-1,48	4,28
EDP	3,270	0,31	7,25
EDP R	8,145	-0,12	4,76
GALP	14,410	0,59	4,46
IBERSOL	8,120	-0,25	2,78
J MARTINS	12,540	-1,49	21,28
MOTA ENGIL	1,932	-0,10	20,00
NAVIGATOR	4,322	2,27	20,06
NOS	5,340	-1,20	0,85
NOVABASE	2,470	-1,98	22,28
PHAROL	0,181	0,22	10,66
REN	2,588	-0,31	6,33
SEMAPA	15,640	1,43	19,39
SONAE CAP.	0,890	-0,22	4,83
SONAE SGPS	0,915	1,61	12,90

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NAVIGATOR	2,27
SONAE SGPS	1,61
SEMAPA	1,43
GALP	0,59
EDP	0,31
NOS	-1,20
CTT	-1,48
J MARTINS	-1,49
CORT. AMORIM	-1,84
NOVABASE	-1,98



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.139,36	-0,08%	8,62%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.160,52	-0,16%	9,09%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.239,41	-0,17%	7,93%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.309,21	0,09%	7,11%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.782,64	0,25%	11,00%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.136,40	-0,21%	6,98%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.302,65	0,10%	6,43%	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.