

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

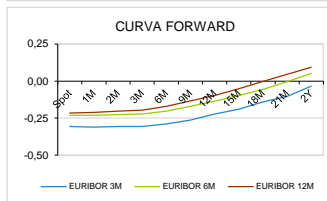
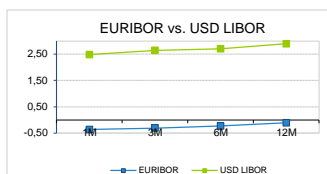
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

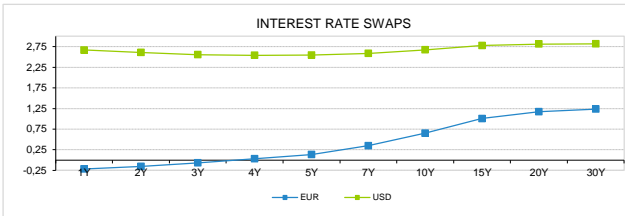
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3660	0	0	1M	2,4844	-1	-3	0,7289	-0,7772
3M	-0,3090	0	0	3M	2,6463	0	-13	0,8593	-0,7108
6M	-0,2300	0	1	6M	2,7060	0	-15	0,9954	-0,6528
12M	-0,1080	0	1	12M	2,8916	0	-15	1,1381	-0,5144

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2164	0	0	-0,0972	0,3110	0,7600
2Y	-0,1550	1	-1	-0,0016	0,4211	0,8740
3Y	-0,0680	1	-2	0,1023	0,5320	0,9830
4Y	0,0300	1	-5	0,2083	0,6450	1,0881
5Y	0,1330	1	-7	0,3175	0,7563	1,1760
7Y	0,3470	1	-11	0,5360	0,9565	1,3230
10Y	0,6520	1	-15	0,8278	1,1782	1,4645
15Y	1,0060	1	-16	1,1272	1,3657	1,5500
20Y	1,1710	1	-15	1,2554	1,4189	1,5370
30Y	1,2370	1	-15	1,2887	1,3885	1,4574

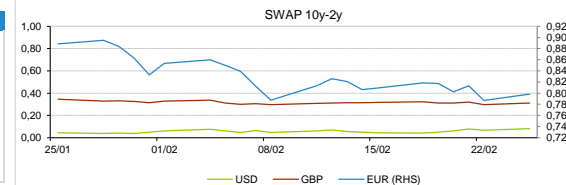
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



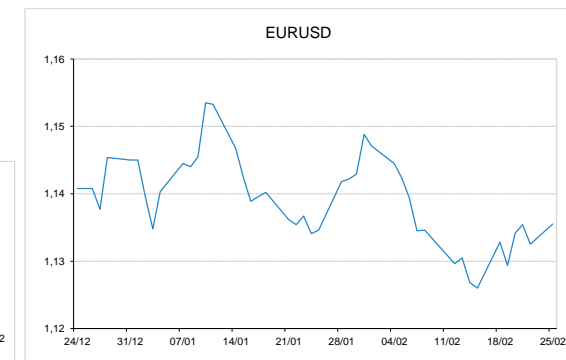
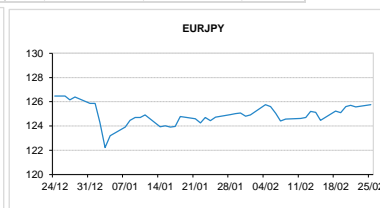
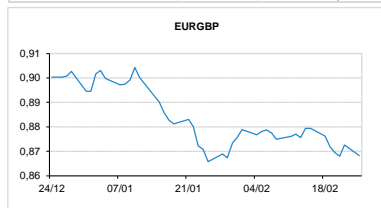
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6660	-1	-12	2,5468	2,4889	2,6495
2Y	2,6070	-2	-14	2,4984	2,5100	2,7000
3Y	2,5550	-3	-14	2,4951	2,5640	2,7667
4Y	2,5380	-3	-13	2,5149	2,6030	2,7880
5Y	2,5420	-3	-13	2,5465	2,6490	2,8467
7Y	2,5850	-3	-13	2,6160	2,7110	3,9359
10Y	2,6720	-3	-11	2,7010	2,8160	3,6934
15Y	2,7750	-3	-10	2,8142	2,8690	3,4860
20Y	2,8120	-3	-9	2,8197	2,8965	3,3667
30Y	2,8180	-3	-8	2,8280	2,8560	3,5539



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,87	-2,25	3,28	OT 2Y	-0,245	0,00	-5,80
JETFUEL	639,75	-15,33	31,84	OT 5Y	0,301	-0,02	-17,60
DIESEL	612,00	-14,83	39,34	OT 10Y	1,465	-0,02	-18,60
COBRE	6.477,00	98,00	543,00	BUND 10Y	-0,471	1,43	-7,90
ZINCO	2.745,50	42,00	155,00	SCHATZ 2Y	0,062	0,92	2,30
OURO	1.327,11	-5,75	29,39	T-NOTE 10Y	3,388	1,48	-2,60
TRIGO	477,00	-14,75	-50,00	T-NOTE 2Y	2,879	1,75	-2,20
LICENÇA C02	19,25	0,31	-4,68	GILT 10Y	1,410	1,33	-8,60


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1355	0,26%	0,08%	1,1441	1,1529	1,1711
EUR/GBP	0,86828	0,50%	-0,29%	0,8709	0,8737	0,8800
EUR/JPY	125,75	-0,15%	-0,82%	125,75	125,75	125,75
EUR/CHF	1,1350	-0,11%	-0,19%	1,1340	1,1329	1,1305
EUR/BRL	4,2324	0,32%	1,68%	4,2914	4,3579	4,4872
EUR/PLN	4,3370	0,00%	-1,16%	4,3579	4,3795	4,4243

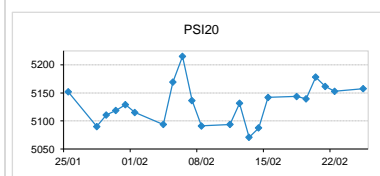

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1355	0,8683	125,75	1,1350	10,5710	7,4612	1,4948	1,58213	4,2324	9,7647
USD	0,8813	-	0,7653	110,875	1,0002	9,3151	6,5763	1,3176	1,3944	3,7338	8,5994

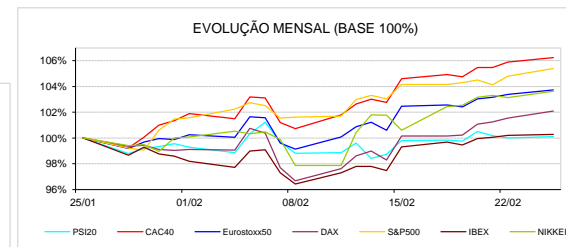
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,140	0,00	23,10
BCP	0,233	0,74	1,35
CORT. AMORIM	9,360	-0,43	4,00
CTT	2,792	-0,07	-5,23
EDP	3,202	-1,54	5,02
EDP R	8,255	0,49	6,17
GALP	14,605	-0,48	5,87
IBERSOL	7,960	-2,21	0,76
J MARTINS	13,130	1,47	26,98
MOTA ENGIL	2,025	3,95	25,78
NAVIGATOR	4,394	0,18	22,06
NOS	5,355	0,94	1,13
NOVABASE	2,450	1,66	21,29
PHAROL	0,186	0,87	13,73
REN	2,600	0,00	6,82
SEMAPA	15,420	-0,13	17,71
SONAE CAP.	0,874	0,00	2,94
SONAE SGPS	0,905	-0,44	11,67

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	3,95
NOVABASE	1,66
J MARTINS	1,47
NOS	0,94
PHAROL	0,87
CORT. AMORIM	-0,43
SONAE SGPS	-0,44
GALP	-0,48
EDP	-1,54
IBERSOL	-2,21



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.157,63	0,10%	9,01%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.233,91	0,35%	10,64%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.281,62	0,34%	9,34%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.517,05	0,52%	9,07%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.808,38	0,57%	12,04%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.210,50	0,06%	7,85%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.528,23	0,48%	7,56%	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.