

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

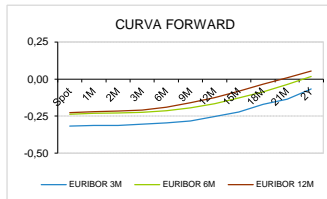
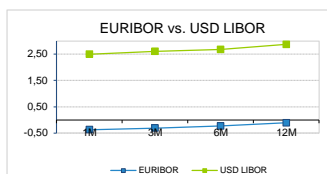
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

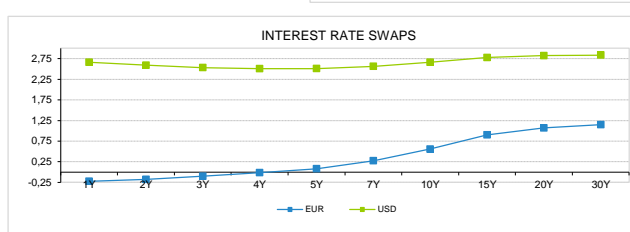
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4989	1	0	0,7263	-0,7840
3M	-0,3090	0	0	3M	2,6083	1	-8	0,8425	-0,7112
6M	-0,2310	0	0	6M	2,6793	0	-5	0,9719	-0,6486
12M	-0,1080	0	0	12M	2,8690	1	-6	1,1060	-0,5056

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2247	0	-1	-0,1258	0,2528	0,6784
2Y	-0,1770	1	-2	-0,0348	0,3577	0,7856
3Y	-0,1000	1	-2	0,0613	0,4639	0,8895
4Y	-0,0140	1	-2	0,1621	0,5705	0,9896
5Y	0,0810	1	-3	0,2644	0,6745	1,0765
7Y	0,2730	1	-6	0,4701	0,8701	1,2331
10Y	0,5570	-1	-9	0,7536	1,0905	1,3838
15Y	0,9010	-2	-10	1,0519	1,2854	1,4837
20Y	1,0700	-3	-10	1,1921	1,3542	1,4824
30Y	1,1480	-3	-8	1,2438	1,3435	1,4158

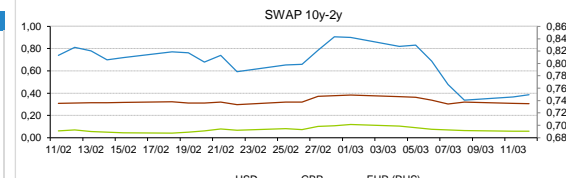
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



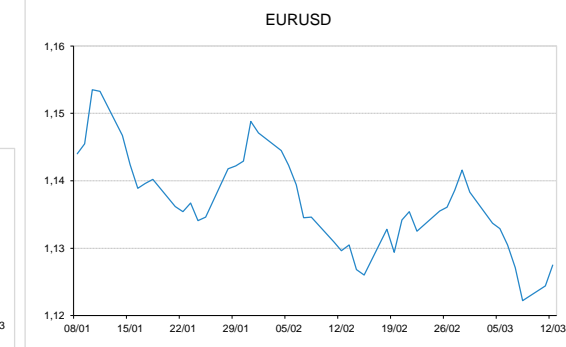
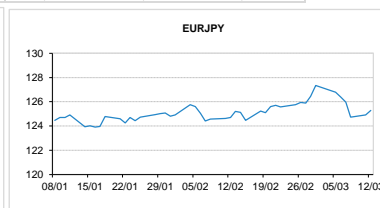
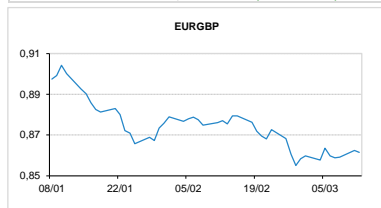
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6600	-1	-3	2,5003	2,3810	2,5875
2Y	2,5890	-1	-2	2,4235	2,4250	2,6415
3Y	2,5310	-1	-2	2,4090	2,4770	2,6960
4Y	2,5070	-1	-2	2,4220	2,5310	2,7430
5Y	2,5100	-1	-2	2,4540	2,5840	2,8064
7Y	2,5610	-1	-1	2,5350	2,6740	2,8460
10Y	2,6600	-1	1	2,6510	2,7690	2,8880
15Y	2,7760	-1	2	2,7520	2,8290	2,9060
20Y	2,8210	-1	4	2,7890	2,8410	2,8950
30Y	2,8350	0	5	2,7950	2,8260	2,8560



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	66,79	0,21	4,39	OT 2Y	-0,245	0,02	-4,00
JETFUEL	644,75	-3,40	23,25	OT 5Y	0,228	0,02	-21,00
DIESEL	612,75	-1,80	22,00	OT 10Y	1,336	0,02	-31,50
COBRE	6.421,50	12,00	257,00	BUND 10Y	-0,337	-0,15	-2,60
ZINCO	2.763,50	41,00	111,50	SCHATZ 2Y	0,069	-0,23	1,20
OURO	1.297,61	6,51	-12,91	T-NOTE 10Y	3,309	-1,14	-0,80
TRIGO	450,75	22,25	-71,00	T-NOTE 2Y	2,797	-1,56	3,70
LICENÇA C02	22,35	0,07	1,65	GILT 10Y	1,101	-0,09	1,30


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1275	0,28%	-0,19%	1,1362	1,1451	1,1629
EUR/GBP	0,86145	0,11%	1,81%	0,8642	0,8671	0,8732
EUR/JPY	125,27	0,00%	-0,46%	125,27	125,27	125,27
EUR/CHF	1,1371	-0,04%	0,22%	1,1361	1,1349	1,1327
EUR/BRL	4,2959	0,54%	-2,03%	4,3593	4,4263	4,5561
EUR/PLN	4,2962	0,12%	0,83%	4,3172	4,3387	4,3826

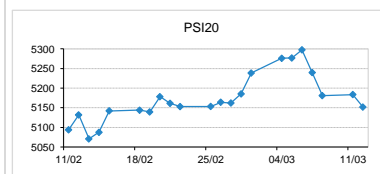

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1275	0,8615	125,27	1,1371	10,5708	7,4597	1,5106	1,59418	4,2959	9,7465
USD	0,8872	-	0,7618	111,245	1,0076	9,3718	6,6183	1,3379	1,4111	3,8104	8,6317

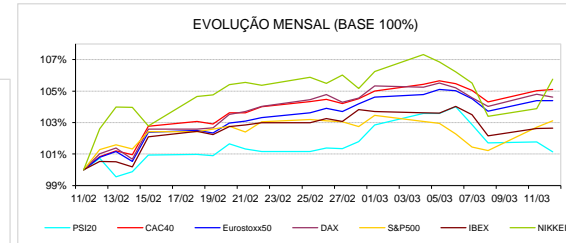
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,120	-2,47	22,76
BCP	0,223	-1,76	-2,66
CORT. AMORIM	10,660	-1,66	18,44
CTT	2,792	0,58	-5,23
EDP	3,247	-0,67	6,49
EDP R	8,555	-0,81	10,03
GALP	14,085	-0,81	2,10
IBERSOL	8,000	-0,25	1,27
J MARTINS	12,870	0,08	24,47
MOTA ENGIL	2,135	0,23	32,61
NAVIGATOR	4,258	-1,62	18,28
NOS	5,425	0,74	2,46
NOVABASE	2,530	0,80	25,25
PHAROL	0,185	0,22	13,60
REN	2,666	-0,38	9,53
SEMAPA	14,940	-0,80	14,05
SONAE CAP.	0,888	0,23	4,59
SONAE SGPS	0,936	-0,58	15,49

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOVABASE	0,80
NOS	0,74
CTT	0,58
REN	0,38
MOTA ENGIL	0,23
EDP R	-0,81
NAVIGATOR	-1,62
CORT. AMORIM	-1,66
BCP	-1,76
ALTRI	-2,47



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.151,60	-0,62%	8,88%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.270,25	0,08%	11,41%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.304,50	0,00%	10,10%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.524,17	-0,17%	9,14%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.794,39	0,40%	11,47%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.173,30	0,02%	7,42%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.503,69	1,79%	7,44%	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.