AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

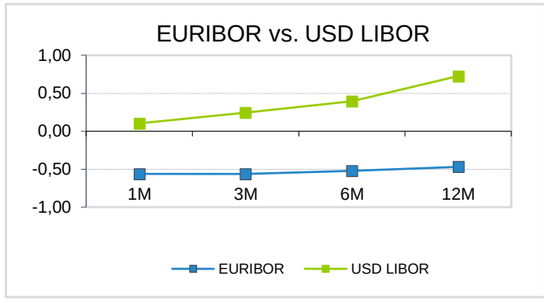
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

Newsletter Diária
17-jan-2022

RENDA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES

EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP	CHF
1M	-0,5620	0	5	1M	0,1033	0	0	0,2724	-0,7000
3M	-0,5600	1	2	3M	0,2413	0	3	0,3991	-0,7150
6M	-0,5230	1	3	6M	0,3950	0	10	0,5605	-0,6650
12M	-0,4700	1	4	12M	0,7257	1	23	0,8309	-0,7000

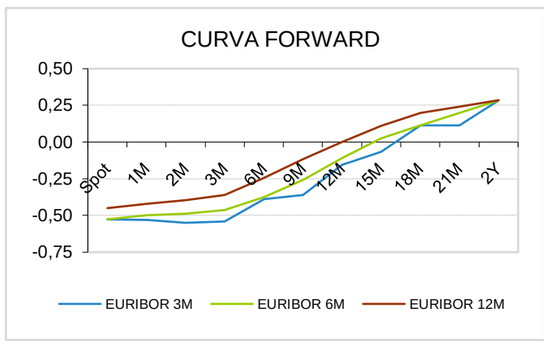


INTEREST RATE SWAPS

EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4500	1	6	0,0035	0,3630	0,4870
2Y	-0,2240	1	15	0,1430	0,3885	0,5390
3Y	-0,0550	1	20	0,2168	0,4230	0,5870
4Y	0,0490	1	23	0,2670	0,4630	0,6430
5Y	0,1220	2	25	0,3100	0,5080	0,6840
7Y	0,2400	2	29	0,4025	0,6020	0,7460
10Y	0,4010	1	30	0,5370	0,6890	0,7905
15Y	0,5630	1	29	0,6510	0,7310	0,7670
20Y	0,5995	0	29	0,6520	0,6910	0,6890
30Y	0,5175	0	27	0,5420	0,5470	0,5340

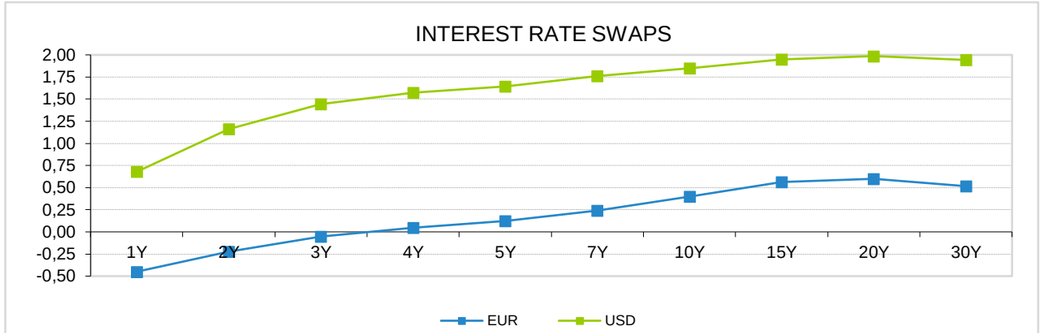
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL

Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,25
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	9,25
Austrália	0,10
Índia	4,00

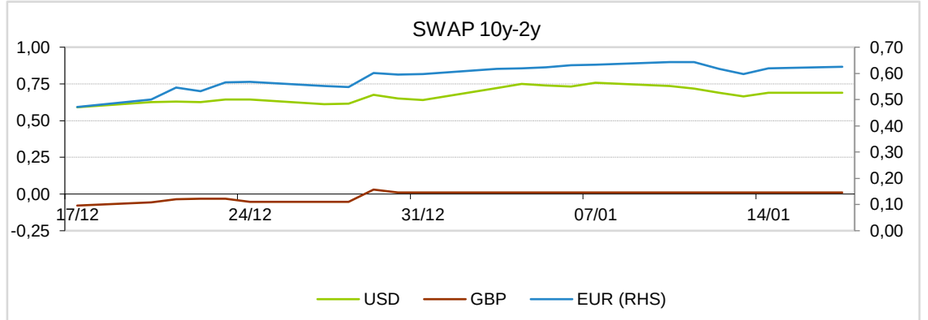


INTEREST RATE SWAPS | **FORWARDS**

USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,6790	3	24	1,5965	1,9782	2,0472
2Y	1,1610	0	29	1,8047	1,9535	1,9489
3Y	1,4420	1	34	1,8613	1,9240	2,0415
4Y	1,5719	1	36	1,9339	1,9620	2,0076
5Y	1,6440	0	38	1,9139	2,0093	2,0782
7Y	1,7600	0	39	1,9478	2,0437	2,0846
10Y	1,8504	0	38	2,0028	2,0866	2,1274
15Y	1,9497	0	36	2,0542	2,1017	2,1263
20Y	1,9866	0	34	2,0605	2,0805	2,0813
30Y	1,9430	0	32	1,9831	1,9470	1,9283

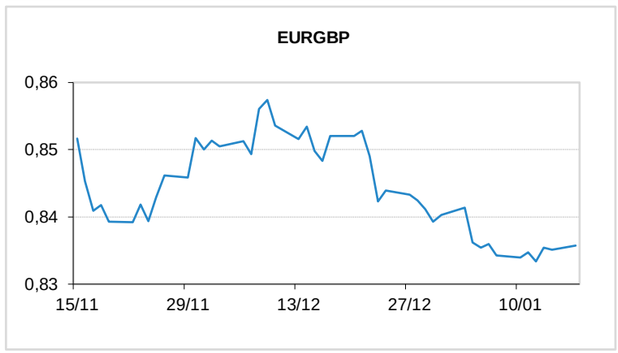


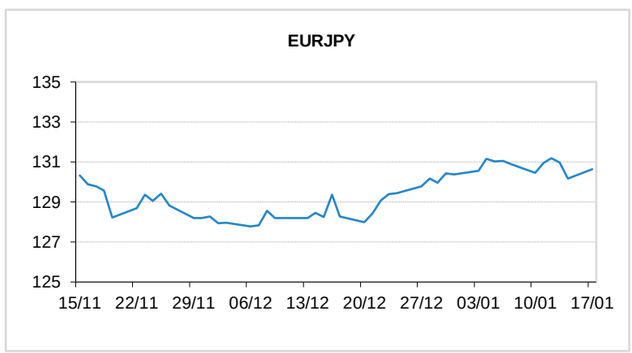
COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	86,33	0,27	12,81	OT 2Y	-0,564	0,01	12,00
JETFUEL	807,50	20,75	130,75	OT 5Y	-0,168	0,01	18,80
DIESEL	760,75	18,00	115,00	OT 10Y	0,575	0,02	27,30
COBRE	9.731,50	-239,00	307,50	BUND 10Y	-0,701	2,86	30,20
ZINCO	3.536,50	-46,00	219,25	SCHATZ 2Y	0,034	1,84	10,30
OURO	1.818,91	0,97	20,80	T-NOTE 10Y	2,795	3,88	32,40
TRIGO	741,50	-5,25	-45,50	T-NOTE 2Y	1,648	4,73	32,60
LICENÇA C02	80,12	-1,96	6,10	GILT 10Y	1,513	3,45	38,20

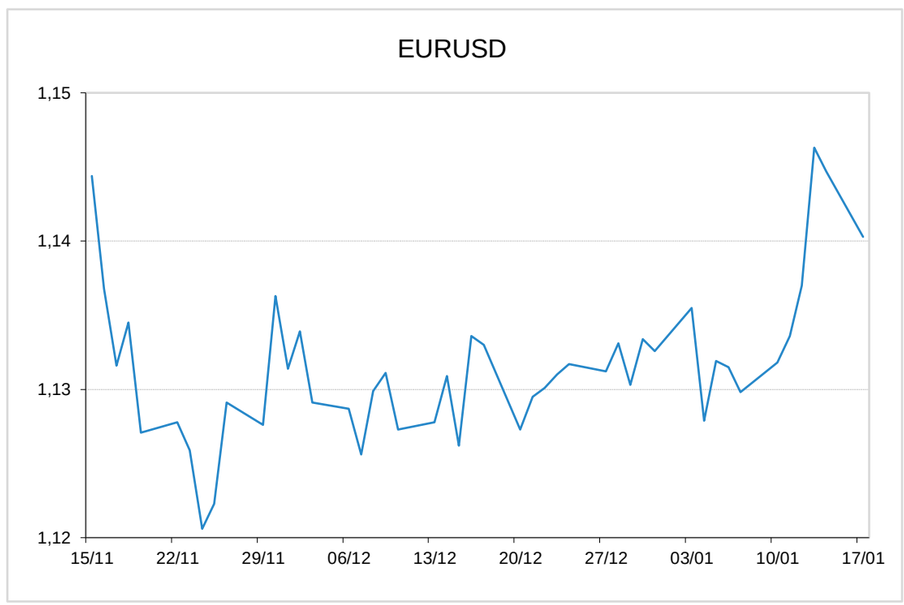


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1403	-0,38%	0,64%	1,1427	1,1460	1,1548
EUR/GBP	0,83573	-0,08%	1,96%	0,8378	0,8406	0,8477
EUR/JPY	130,64	-0,36%	-1,81%	130,64	130,64	130,64
EUR/CHF	1,0424	0,09%	-0,35%	1,0419	1,0414	1,0405
EUR/BRL	6,3004	0,17%	1,41%	6,4625	6,6564	7,0686
EUR/PLN	4,5219	0,30%	2,44%	4,5581	4,6086	4,7191







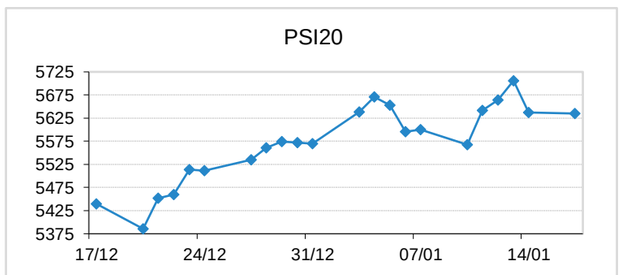
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1403	0,8357	130,64	1,0424	10,2788	7,4421	1,4279	1,58169	6,3004	9,9484
USD	0,8770	-	0,7327	114,615	0,9141	9,0130	6,5269	1,2522	1,3871	5,5081	8,7237

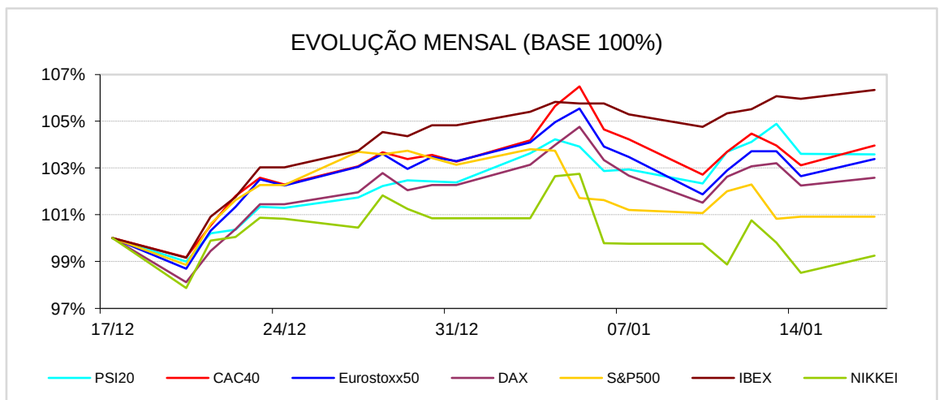
ACCIONISTA

TITULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,625	-0,18	0,27
BCP	0,167	-2,35	18,17
CORT. AMORIM	10,520	0,00	-6,74
CTT	4,380	0,00	-3,84
EDP	4,486	-0,24	-7,16
EDP R	19,280	0,52	-11,96
GALP	9,826	0,22	15,33
IBERSOL	5,080	-1,17	-1,93
J MARTINS	21,200	1,34	5,47
MOTA ENGIL	1,280	-0,39	0,31
NAVIGATOR	3,316	-0,90	-1,01
NOVABASE	5,520	-0,36	7,81
NOS	3,400	0,41	-0,29
PHAROL	0,082	1,24	8,52
RAMADA	7,100	-0,28	0,28
REN	2,520	-0,20	-0,98
SEMAPA	11,680	-0,17	-0,17
SONAE SGPS	1,039	0,29	3,59
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

MAIORES GANHOS/PERDAS	Variação %
J MARTINS	1,34
PHAROL	1,24
EDP R	0,52
NOS	0,41
SONAE SGPS	0,29
NOVABASE	-0,36
MOTA ENGIL	-0,39
NAVIGATOR	-0,90
IBERSOL	-1,17
BCP	-2,35



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.634,78	-0,04%	1,17%	5.835,45	4.617,86
CAC40	7.201,64	0,82%	0,68%	7.384,86	5.379,22
ESTX 50 PR	4.302,14	0,70%	0,09%	4.415,23	3.473,76
XTRA DAX	15.933,72	0,32%	0,31%	16.290,19	13.310,95
S&P 500	4.662,85	0,08%	-2,17%	4.818,62	3.694,12
IBEX 35	8.838,70	0,36%	1,43%	9.310,80	7.713,50
NIKKEI 225	28.333,52	0,74%	-1,59%	30.795,78	26.954,81



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.