

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

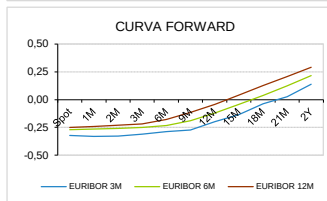
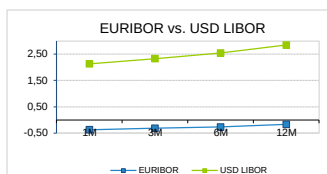
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

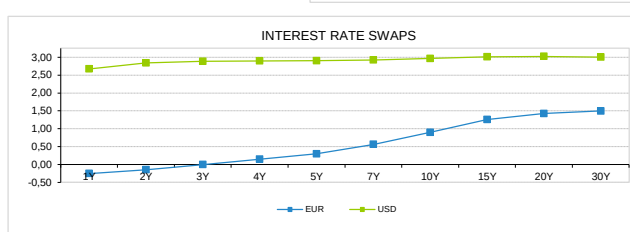
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3720	0	0	1M	2,1326	1	5	0,7223	-0,7812
3M	-0,3190	0	0	3M	2,3271	1	-2	0,8035	-0,7284
6M	-0,2690	0	0	6M	2,5442	0	2	0,8972	-0,6498
12M	-0,1670	0	1	12M	2,8491	1	2	1,0391	-0,5178

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2510	0	-1	-0,0430	0,6190	1,1550
2Y	-0,1460	0	-1	0,1229	0,7650	1,2680
3Y	-0,0010	1	-1	0,2870	0,8940	1,3710
4Y	0,1510	1	-2	0,4416	1,0140	1,4640
5Y	0,2970	1	-2	0,5818	1,1250	1,5460
7Y	0,5640	1	-3	0,8318	1,3160	1,6730
10Y	0,8990	2	-3	1,1300	1,5182	1,7940
15Y	1,2580	2	-2	1,4177	1,6827	1,8640
20Y	1,4240	1	-1	1,5430	1,7275	1,8420
30Y	1,4960	1	-1	1,5740	1,6947	1,7640

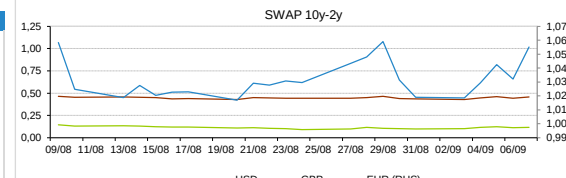
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



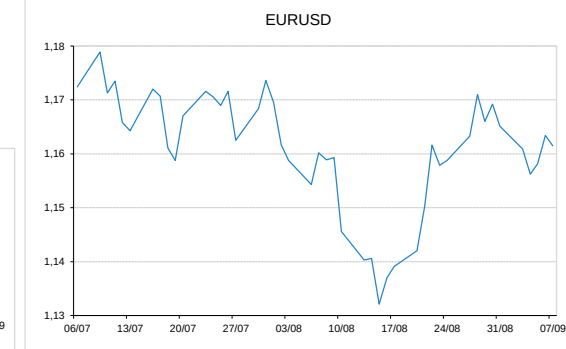
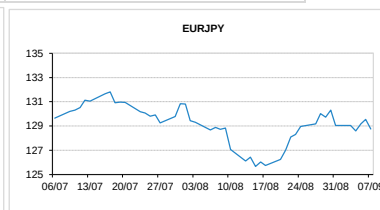
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6730	0	0	3,0700	2,9340	2,9580
2Y	2,8400	0	-3	3,0000	2,9787	2,9560
3Y	2,8850	0	-4	2,9770	2,9345	2,9745
4Y	2,8980	0	-6	2,9645	2,9405	3,0455
5Y	2,9040	0	-6	2,9600	2,9540	3,0638
7Y	2,9230	0	-7	2,9615	2,9790	3,0410
10Y	2,9660	0	-6	3,0526	3,0200	3,0630
15Y	3,0140	0	-5	3,0295	3,0460	3,0575
20Y	3,0250	1	-5	3,0315	3,0295	3,0400
30Y	3,0050	1	-5	3,0020	2,9875	2,9875



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	76,52	0,02	1,53	OT 2Y	-0,106	0,01	5,10
JETFUEL	720,72	3,01	16,29	OT 5Y	0,688	0,02	10,50
DIESEL	683,47	2,51	18,29	OT 10Y	1,899	0,02	12,80
COBRE	5.908,50	56,50	-205,50	BUND 10Y	0,005	3,68	-2,40
ZINCO	2.445,50	15,50	-141,75	SCHATZ 2Y	0,067	1,61	1,20
OURO	1.197,45	-1,51	-14,28	T-NOTE 10Y	3,636	5,38	-3,90
TRIGO	511,00	-2,75	-79,00	T-NOTE 2Y	3,114	5,88	-1,50
LICENÇA C02	23,00	1,53	5,49	GILT 10Y	1,599	3,67	-1,70


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1615	-0,16%	0,11%	1,1696	1,1790	1,1987
EUR/GBP	0,89275	0,62%	0,23%	0,8955	0,8984	0,9048
EUR/JPY	128,74	0,63%	0,11%	128,74	128,74	128,74
EUR/CHF	1,1214	0,22%	2,89%	1,1203	1,1191	1,1169
EUR/BRL	4,7115	2,39%	-8,40%	4,7854	4,8637	5,0503
EUR/PLN	4,3111	0,27%	-1,23%	4,3328	4,3562	4,4056

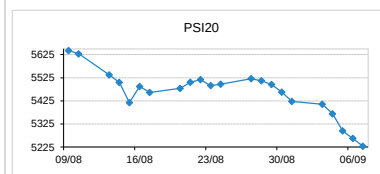

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1615	0,8928	128,74	1,1214	10,5042	7,4567	1,5240	1,62175	4,7115	9,7589
USD	0,8631	-	0,7718	111,125	0,9673	9,0603	6,4366	1,3154	1,3995	4,0552	8,4313

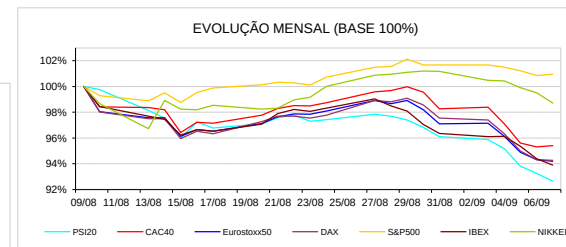
ACCIONISTA

TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,730	0,26	49,49
BCP	0,243	-2,68	-10,55
CORT. AMORIM	11,2000	0,00	8,74
CTT	3,2540	0,99	-7,21
EDP	3,290	-0,12	14,04
EDP R	8,455	0,83	21,36
GALP	16,325	-0,49	6,53
IBERSOL	9,320	0,00	-7,95
J MARTINS	12,340	-0,72	-23,80
MOTA ENGIL	2,165	-1,59	-40,90
NAVIGATOR	4,080	-1,11	-3,32
NOS	4,868	0,08	-11,18
NOVABASE	2,670	-1,84	-12,43
PHAROL	0,189	-0,53	-24,40
REN	2,408	-0,41	-2,86
SEMAPA	17,340	-1,37	-2,56
SONAE CAP.	0,800	-0,62	-9,81
SONAE SGPS	0,889	-1,44	-21,09

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	0,99
EDP R	0,83
ALTRI	0,26
NOS	0,08
SEMAPA	-1,37
SONAE SGPS	-1,44
MOTA ENGIL	-1,59
NOVABASE	-1,84
BCP	-2,68



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.227,74	-0,65%	-2,98%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.249,42	0,11%	-1,19%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.290,70	-0,15%	-6,08%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	11.947,86	-0,04%	-7,49%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.880,85	0,09%	7,75%	2.916,50	2.459,40
IBEX 35	9.158,70	-0,54%	-8,81%	10.643,40	9.111,20
NIKKEI 225	22.307,06	-0,80%	-2,01%	24.129,34	19.239,52



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.