

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

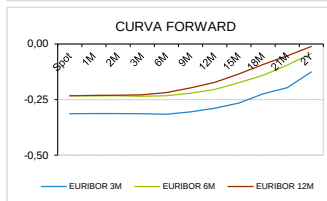
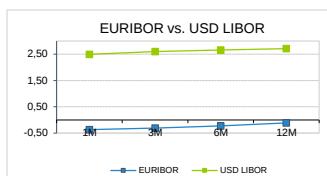
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

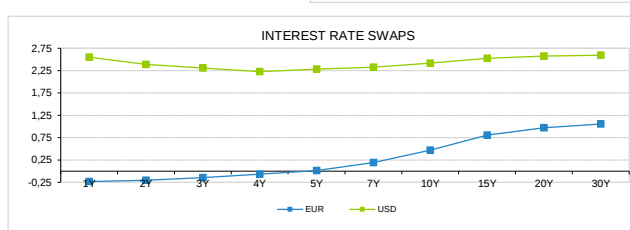
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4945	-1	0	0,7309	-0,7866
3M	-0,3100	0	0	3M	2,5998	1	-2	0,8484	-0,7122
6M	-0,2280	0	0	6M	2,6595	2	-3	0,9548	-0,6304
12M	-0,1120	0	0	12M	2,7106	2	-15	1,0620	-0,4986

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,2320	0	-2	-0,1738	0,1790	0,5760	
2Y	-0,2050	0	-6	-0,0901	0,2634	0,6861	
3Y	-0,1440	1	-10	-0,0020	0,3720	0,7915	
4Y	-0,0680	1	-12	0,0916	0,4758	0,8920	
5Y	0,0140	1	-15	0,1880	0,5820	0,9815	
7Y	0,1940	2	-19	0,3905	0,7760	1,1310	
10Y	0,4710	2	-22	0,6670	0,9971	1,2760	
15Y	0,8080	3	-24	0,9643	1,1931	1,3730	
20Y	0,9730	3	-24	1,0985	1,2567	1,3730	
30Y	1,0550	4	-23	1,1484	1,2435	1,3120	

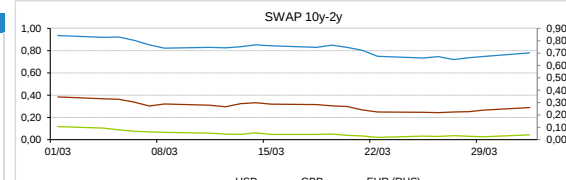
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5500	3	-12	2,3048	2,2650	2,4470
2Y	2,3870	5	-23	2,2290	2,3100	2,4835
3Y	2,3070	5	-27	2,2380	2,3310	2,5320
4Y	2,2260	6	-34	2,2690	2,3890	2,5905
5Y	2,2850	5	-29	2,3070	2,4400	2,6286
7Y	2,3270	5	-30	2,3800	2,5360	2,6500
10Y	2,4160	4	-31	2,5033	2,5800	2,7040
15Y	2,5270	3	-31	2,5983	2,6445	2,7275
20Y	2,5750	3	-30	2,6185	2,6710	2,7050
30Y	2,5940	2	-29	2,6245	2,6590	2,7150

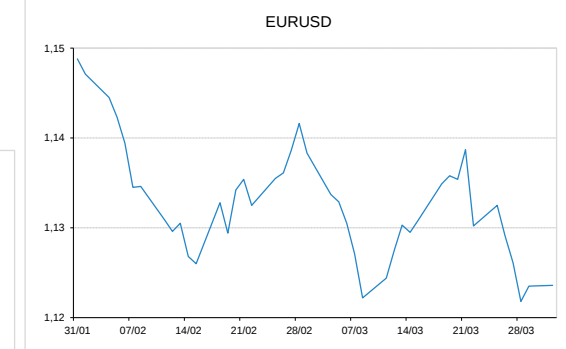
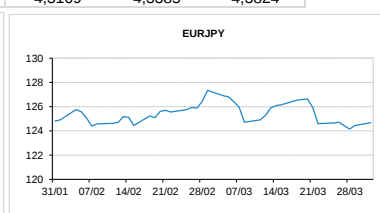


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	68,70	1,12	3,59	OT 2Y	-0,308	0,00	-6,30
JETFUEL	641,40	1,65	-13,60	OT 5Y	0,179	0,01	-12,60
DIESEL	610,00	4,25	-20,73	OT 10Y	1,275	0,02	-19,50
COBRE	6.473,50	122,50	-26,50	BUND 10Y	-0,426	4,03	-21,90
ZINCO	2.974,75	65,75	175,25	SCHATZ 2Y	0,014	0,23	-8,50
OURO	1.291,76	-1,66	-6,79	T-NOTE 10Y	3,210	5,32	-17,80
TRIGO	465,75	8,00	8,50	T-NOTE 2Y	2,667	4,85	-17,50
LICENÇA C02	21,73	0,19	-0,55	GILT 10Y	0,963	4,35	-28,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1236	0,01%	-1,29%	1,1322	1,1408	1,1578
EUR/GBP	0,85658	0,20%	0,36%	0,8593	0,8621	0,8678
EUR/JPY	124,68	-0,18%	2,14%	124,68	124,68	124,68
EUR/CHF	1,1195	-0,28%	1,46%	1,1185	1,1174	1,1152
EUR/BRL	4,3424	1,38%	-1,07%	4,4059	4,4777	4,6092
EUR/PLN	4,2962	0,20%	0,20%	4,3169	4,3385	4,3824



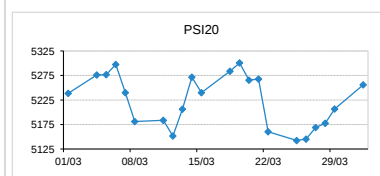
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1236	0,8566	124,68	1,1195	10,4122	7,4652	1,4968	1,57567	4,3424	9,6345
USD	0,8912	-	0,7607	111,19	0,9977	9,2683	6,6528	1,3343	1,4041	3,8686	8,5793

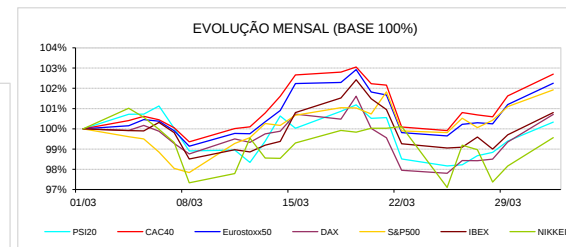
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,045	0,93	21,47
BCP	0,233	1,04	1,39
CORT. AMORIM	10,460	-1,69	16,22
CTT	2,606	1,01	-11,54
EDP	3,520	0,43	15,45
EDP R	8,580	0,94	10,35
GALP	14,460	1,26	4,82
IBERSOL	7,800	0,78	-1,27
J MARTINS	13,220	0,53	27,85
MOTA ENGIL	2,108	3,33	30,93
NAVIGATOR	4,160	1,96	15,56
NOS	5,770	1,23	8,97
NOVABASE	2,490	-0,40	23,27
PHAROL	0,189	-2,07	15,81
REN	2,550	0,31	4,77
SEMAPA	14,720	1,38	12,37
SONAE CAP.	0,875	0,00	3,06
SONAE SGPS	0,944	2,33	16,48

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	3,33
SONAE SGPS	2,33
NAVIGATOR	1,96
SEMAPA	1,38
GALP	1,26
NOVABASE	-0,40
CORT. AMORIM	-1,69
PHAROL	-2,07



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.256,00	0,95%	11,09%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.407,32	1,06%	14,30%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.386,75	1,05%	12,84%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.684,03	1,37%	10,66%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.857,41	0,82%	13,99%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.342,20	1,10%	9,39%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.509,03	1,43%	7,47%	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.