

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

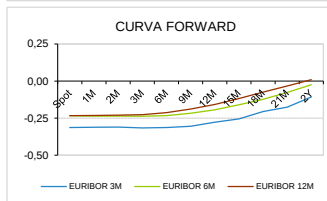
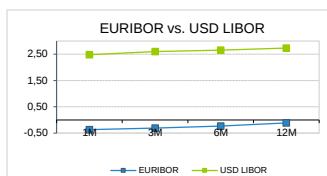
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

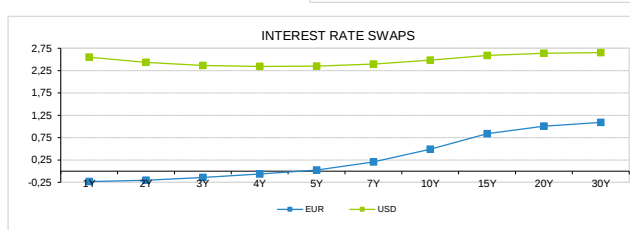
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4794	-1	0	0,7303	-0,7878
3M	-0,3100	0	0	3M	2,6024	1	0	0,8304	-0,7140
6M	-0,2300	0	0	6M	2,6506	-2	-3	0,9466	-0,6540
12M	-0,1120	0	0	12M	2,7333	0	-15	1,0529	-0,5000

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2327	0	-2	-0,1595	0,1984	0,5400
2Y	-0,2030	0	-7	-0,0745	0,3004	0,7180
3Y	-0,1390	0	-10	0,0158	0,4044	0,8260
4Y	-0,0620	0	-13	0,1125	0,5090	0,9270
5Y	0,0230	0	-15	0,2120	0,6147	1,0210
7Y	0,2080	-1	-19	0,4163	0,8090	1,1700
10Y	0,4910	-1	-22	0,6980	1,0354	1,3190
15Y	0,8370	-1	-23	1,0017	1,2346	1,4220
20Y	1,0070	-1	-23	1,1408	1,3017	1,4240
30Y	1,0910	-1	-22	1,1935	1,2914	1,3620

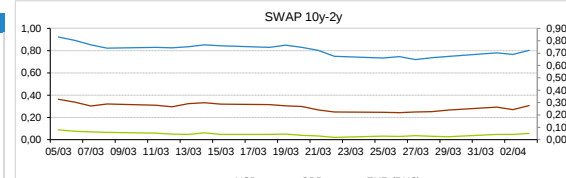
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5500	3	-12	2,3253	2,2948	2,4775
2Y	2,4360	5	-19	2,2480	2,3265	2,5235
3Y	2,3640	6	-23	2,2510	2,3770	2,5440
4Y	2,3430	12	-23	2,2795	2,4110	2,5990
5Y	2,3500	7	-24	2,3165	2,4560	2,6538
7Y	2,3950	7	-25	2,3905	2,5385	2,6835
10Y	2,4830	7	-26	2,5030	2,6250	2,7360
15Y	2,5900	6	-26	2,6060	2,6845	2,7590
20Y	2,6370	6	-26	2,6460	2,7040	2,7305
30Y	2,6530	6	-25	2,6550	2,6600	2,6985

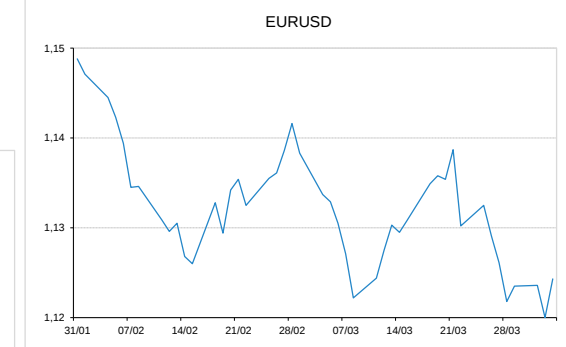
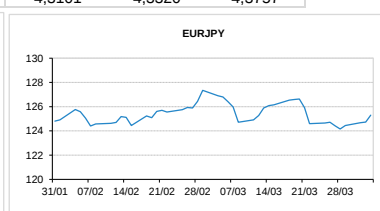


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	69,10	-0,27	3,99	OT 2Y	-0,315	0,00	-6,90
JETFUEL	649,44	-3,61	-5,56	OT 5Y	0,173	0,01	-12,10
DIESEL	615,69	-3,61	-15,04	OT 10Y	1,269	0,01	-19,60
COBRE	6.432,50	-44,50	-51,50	BUND 10Y	-0,396	5,26	-17,00
ZINCO	2.910,00	-69,50	102,50	SCHATZ 2Y	0,030	2,75	-8,50
OURO	1.290,17	0,53	-8,38	T-NOTE 10Y	3,230	2,59	-17,30
TRIGO	465,25	1,25	8,00	T-NOTE 2Y	2,675	2,13	-20,80
LICENÇA C02	23,10	1,09	0,82	GILT 10Y	1,015	9,19	-21,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1243	0,38%	-0,83%	1,1330	1,1417	1,1587
EUR/GBP	0,8539	0,71%	0,45%	0,8566	0,8594	0,8652
EUR/JPY	125,3	-0,45%	1,28%	125,30	125,30	125,30
EUR/CHF	1,1205	-0,25%	1,11%	1,1195	1,1184	1,1161
EUR/BRL	4,3212	-0,02%	-0,62%	4,3853	4,4550	4,5844
EUR/PLN	4,2891	0,22%	0,28%	4,3101	4,3320	4,3757



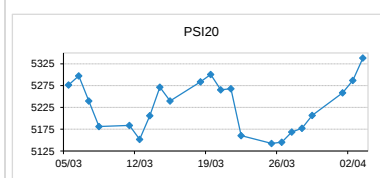
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1243	0,8539	125,30	1,1205	10,4095	7,4649	1,4971	1,57782	4,3212	9,6164
USD	0,8906	-	0,7601	111,485	0,9969	9,2761	6,6472	1,3321	1,4044	3,8391	8,5629

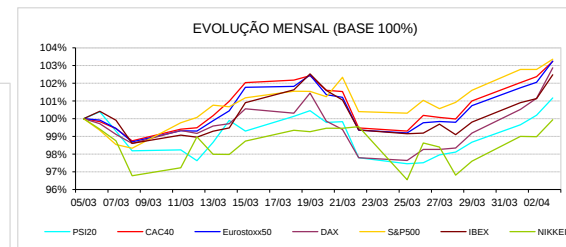
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,290	3,33	25,69
BCP	0,239	1,92	4,31
CORT. AMORIM	10,560	0,00	17,33
CTT	2,660	0,53	-9,71
EDP	3,550	0,91	16,43
EDP R	8,460	-0,47	8,81
GALP	14,345	-0,80	3,99
IBERSOL	7,900	1,02	0,00
J MARTINS	13,610	1,91	31,62
MOTA ENGIL	2,302	5,89	42,98
NAVIGATOR	4,194	0,72	16,50
NOS	5,995	1,44	13,22
NOVABASE	2,490	-0,40	23,27
PHAROL	0,192	3,11	17,89
REN	2,570	-0,19	5,59
SEMAPA	14,680	0,69	12,06
SONAE CAP.	0,875	0,34	3,06
SONAE SGPS	0,951	0,80	17,35

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	5,89
ALTRI	3,33
PHAROL	3,11
BCP	1,92
J MARTINS	1,91
REN	-0,19
NOVABASE	-0,40
EDP R	-0,47
GALP	-0,80



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.338,48	0,97%	12,83%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.468,91	0,84%	15,60%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.435,56	1,17%	14,46%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.954,40	1,70%	13,22%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.883,20	0,56%	15,02%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.487,80	1,33%	11,10%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.713,21	0,97%	8,49%	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.