

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

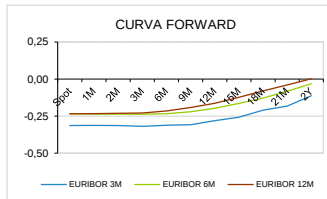
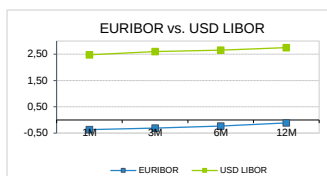
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

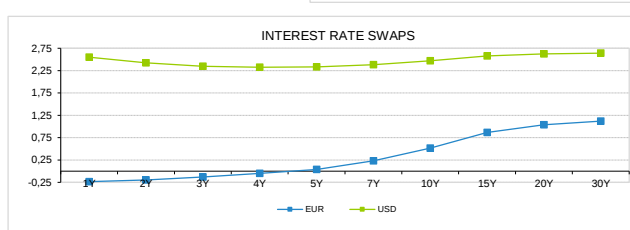
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4771	0	0	0,7344	-0,7894
3M	-0,3100	0	0	3M	2,5978	0	0	0,8376	-0,7144
6M	-0,2300	0	0	6M	2,6551	0	-3	0,9458	-0,6512
12M	-0,1120	0	0	12M	2,7495	2	-13	1,0690	-0,4996

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2340	0	-2	-0,1649	0,1988	0,6062
2Y	-0,1960	1	-6	-0,0805	0,2994	0,7139
3Y	-0,1300	1	-9	0,0130	0,4011	0,8197
4Y	-0,0490	1	-12	0,1091	0,5054	0,9140
5Y	0,0390	2	-14	0,2077	0,6095	1,0070
7Y	0,2300	2	-17	0,4103	0,8010	1,1500
10Y	0,5170	3	-19	0,6867	1,0151	1,2930
15Y	0,8660	3	-20	0,9766	1,2023	1,3880
20Y	1,0370	3	-20	1,1121	1,2685	1,3860
30Y	1,1200	3	-19	1,1576	1,2524	1,3200

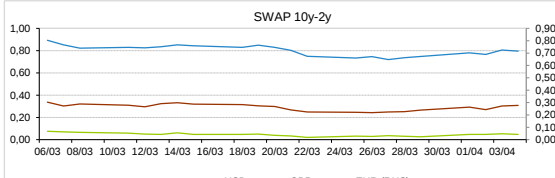
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5500	3	-12	2,3186	2,2410	2,4635
2Y	2,4230	-1	-21	2,2671	2,3125	2,5020
3Y	2,3480	-2	-24	2,2736	2,3590	2,5540
4Y	2,3250	-2	-25	2,3017	2,3950	2,6101
5Y	2,3310	-2	-26	2,3360	2,4717	2,6472
7Y	2,3800	-2	-26	2,4097	2,5499	2,6800
10Y	2,4710	-1	-27	2,5149	2,6357	2,7280
15Y	2,5780	-1	-28	2,5980	2,6790	2,7510
20Y	2,6250	-1	-27	2,6611	2,6845	2,7450
30Y	2,6400	-1	-27	2,6763	2,6855	2,7220

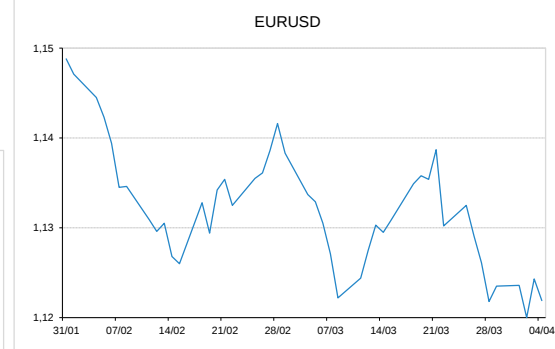
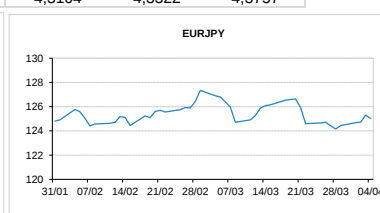


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	69,60	0,29	3,86	OT 2Y	-0,313	0,00	-7,00
JETFUEL	653,51	4,07	1,91	OT 5Y	0,177	0,00	-11,20
DIESEL	619,76	4,07	-3,59	OT 10Y	1,262	-0,01	-19,60
COBRE	6.495,50	65,50	14,00	BUND 10Y	-0,404	-0,65	-18,40
ZINCO	2.981,50	71,50	174,00	SCHATZ 2Y	0,034	0,46	-7,90
OURO	1.288,06	-2,87	1,41	T-NOTE 10Y	3,226	-0,49	-17,50
TRIGO	471,00	0,00	15,50	T-NOTE 2Y	2,687	0,97	-20,60
LICENÇA C02	24,40	1,24	1,27	GILT 10Y	1,016	1,46	-21,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1219	-0,21%	-1,04%	1,1305	1,1391	1,1562
EUR/GBP	0,85418	-0,03%	0,42%	0,8569	0,8597	0,8655
EUR/JPY	125,01	0,23%	1,52%	125,01	125,01	125,01
EUR/CHF	1,1218	-0,04%	0,99%	1,1208	1,1197	1,1175
EUR/BRL	4,3437	0,10%	-1,16%	4,4080	4,4779	4,6108
EUR/PLN	4,2892	0,03%	0,28%	4,3104	4,3322	4,3757



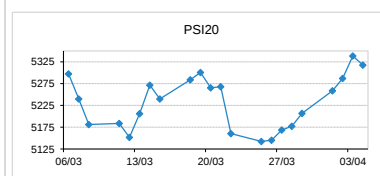
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1219	0,8542	125,01	1,1218	10,4090	7,4649	1,4980	1,57725	4,3437	9,6377
USD	0,8916	-	0,7644	111,585	0,9998	9,2740	6,6555	1,3351	1,4060	3,8669	8,5843

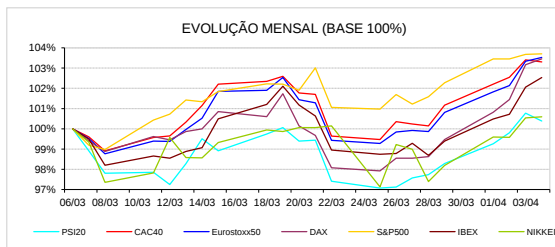
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,175	-1,58	23,71
BCP	0,240	0,21	4,53
CORT. AMORIM	10,420	-1,33	15,78
CTT	2,614	-1,73	-11,27
EDP	3,530	-0,56	15,78
EDP R	8,500	0,47	9,32
GALP	14,220	-0,87	3,08
IBERSOL	7,920	0,25	0,25
J MARTINS	13,540	-0,51	30,95
MOTA ENGIL	2,318	0,70	43,98
NAVIGATOR	4,180	-0,33	16,11
NOS	6,010	0,25	13,50
NOVABASE	2,490	0,00	23,27
PHAROL	0,190	-1,35	16,30
REN	2,555	-0,58	4,97
SEMAPA	14,580	-0,68	11,30
SONAE CAP.	0,877	0,23	3,30
SONAE SGPS	0,947	-0,37	16,91

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	0,70
EDP R	0,47
IBERSOL	0,25
NOS	0,25
SONAE CAP.	0,23
GALP	-0,87
CORT. AMORIM	-1,33
PHAROL	-1,35
ALTRI	-1,58
CTT	-1,73



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.317,72	-0,39%	12,39%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.463,80	-0,09%	15,50%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.441,91	0,18%	14,68%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.988,01	0,28%	13,53%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.874,30	0,02%	14,65%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.532,10	0,47%	11,62%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.724,95	0,05%	8,54%	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.