

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

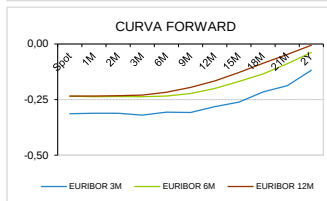
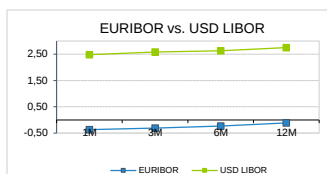
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

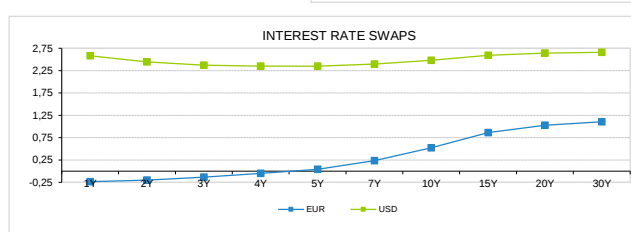
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4813	1	-1	0,7288
3M	-0,3100	0	0	3M	2,5840	-1	-1	0,8181
6M	-0,2310	0	0	6M	2,6316	-1	-5	0,9404
12M	-0,1120	0	0	12M	2,7499	0	-11	1,0724
								-0,4988

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2337	0	-1	-0,1685	0,1826	0,6023
2Y	-0,1990	0	-2	-0,0856	0,2838	0,7113
3Y	-0,1330	-1	-2	0,0042	0,3880	0,8182
4Y	-0,0490	-1	-3	0,0998	0,4965	0,9130
5Y	0,0410	-1	-3	0,1995	0,5975	1,0020
7Y	0,2340	-1	-3	0,4040	0,7930	1,1490
10Y	0,5220	-1	-4	0,6820	1,0104	1,2920
15Y	0,8620	-1	-6	0,9732	1,1984	1,3850
20Y	1,0280	-2	-7	1,1082	1,2637	1,3820
30Y	1,1050	-2	-7	1,1511	1,2451	1,3130

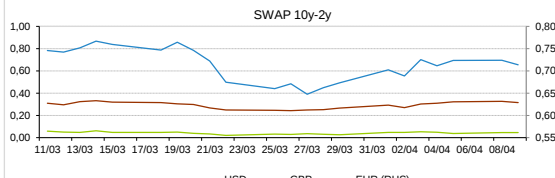
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5810	0	-10	2,2877	2,2503	2,4736
2Y	2,4460	0	-21	2,2230	2,3012	2,4990
3Y	2,3710	-1	-24	2,2447	2,3320	2,5430
4Y	2,3510	3	-23	2,2685	2,4045	2,5800
5Y	2,3490	-1	-25	2,3071	2,4360	2,6345
7Y	2,3940	-2	-26	2,3867	2,5318	2,6916
10Y	2,4810	-2	-26	2,4986	2,6198	2,7372
15Y	2,5920	-2	-26	2,5830	2,6670	2,7652
20Y	2,6410	-2	-25	2,6250	2,7045	2,7360
30Y	2,6590	-2	-25	2,6390	2,6760	2,7075

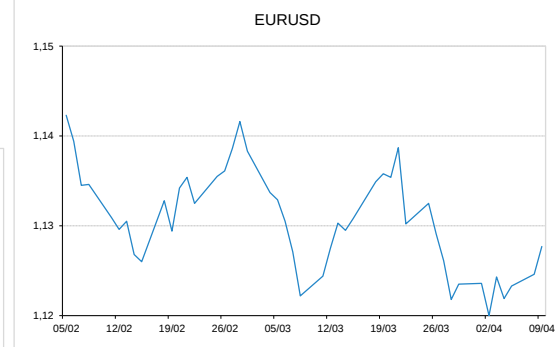
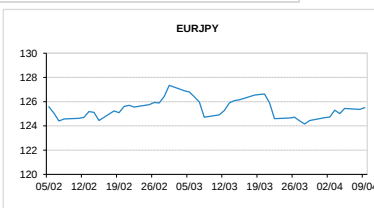
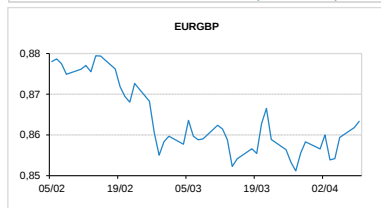


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	70,72	-0,38	5,06	OT 2Y	-0,331	-0,01	-6,20
JETFUEL	661,10	-2,57	21,41	OT 5Y	0,144	-0,01	-7,80
DIESEL	629,60	-1,57	19,66	OT 10Y	1,197	-0,03	-15,10
COBRE	6.486,00	74,00	80,00	BUND 10Y	-0,406	-1,08	-8,10
ZINCO	2.955,00	-19,00	232,50	SCHATZ 2Y	0,044	0,69	-3,40
OURO	1.305,97	8,09	7,82	T-NOTE 10Y	3,213	-2,27	-9,50
TRIGO	460,75	-4,50	21,25	T-NOTE 2Y	2,689	-1,94	-11,20
LICENÇA C02	25,49	1,18	2,47	GILT 10Y	1,030	-0,27	-9,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1277	0,28%	0,29%	1,1365	1,1451	1,1626
EUR/GBP	0,86335	-0,18%	-0,11%	0,8660	0,8688	0,8748
EUR/JPY	125,51	-0,12%	-0,48%	125,51	125,51	125,51
EUR/CHF	1,1277	-0,20%	0,79%	1,1267	1,1256	1,1234
EUR/BRL	4,3475	-0,19%	-0,63%	4,4128	4,4830	4,6149
EUR/PLN	4,2867	0,04%	0,35%	4,3080	4,3297	4,3746



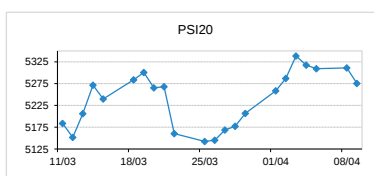
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1277	0,8634	125,51	1,1277	10,4266	7,4662	1,5021	1,58191	4,3475	9,6318
USD	0,8872	-	0,7665	111,125	1,0003	9,2493	6,6230	1,3319	1,4018	3,8574	8,5481

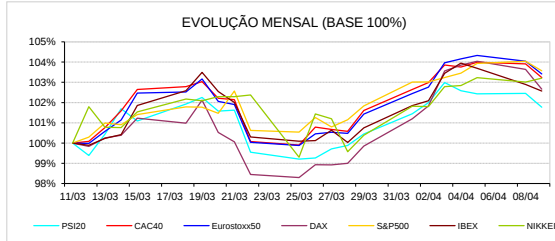
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,130	-1,99	22,93
BCP	0,237	-1,08	3,44
CORT. AMORIM	10,120	-0,59	12,44
CTT	2,618	-0,15	-11,13
EDP	3,473	-1,19	13,91
EDP R	8,490	-0,82	9,20
GALP	14,375	0,14	4,20
IBERSOL	8,040	0,00	1,77
J MARTINS	13,455	-0,77	30,13
MOTA ENGL	2,236	-2,02	38,88
NAVIGATOR	4,124	-0,82	14,56
NOS	5,935	-0,25	12,09
NOVABASE	2,490	0,81	23,27
PHAROL	0,185	-0,86	13,11
REN	2,545	0,00	4,56
SEMAPA	14,540	-0,82	10,99
SONAE CAP.	0,882	-1,78	3,89
SONAE SGPS	0,933	-0,16	15,19

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOVABASE	0,81
GALP	0,14
BCP	-1,08
EDP	-1,19
SONAE CAP.	-1,78
ALTRI	-1,99
MOTA ENGL	-2,02



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.275,60	-0,67%	11,50%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.436,42	-0,65%	14,92%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.417,22	-0,61%	13,85%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.850,57	-0,94%	12,23%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.882,37	-0,46%	14,99%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.407,80	-0,32%	10,16%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.802,59	0,19%	8,93%	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.