

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

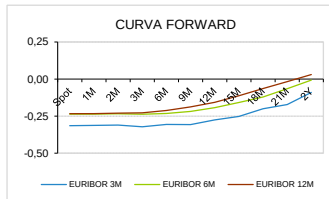
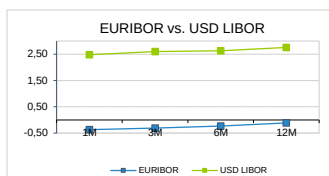
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

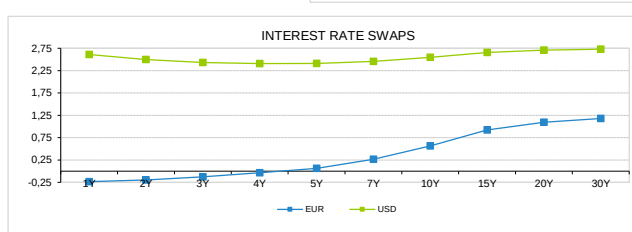
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4798	1	0	0,7339	-0,7904
3M	-0,3110	0	0	3M	2,6009	1	-2	0,8218	-0,7178
6M	-0,2320	0	0	6M	2,6314	-1	-4	0,9471	-0,6534
12M	-0,1120	0	0	12M	2,7553	0	-9	1,1046	-0,5112

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2340	0	-1	-0,1582	0,2518	0,7005
2Y	-0,1960	0	-2	-0,0632	0,3625	0,8047
3Y	-0,1260	0	-3	0,0414	0,4776	0,9103
4Y	-0,0360	0	-3	0,1492	0,5854	1,0109
5Y	0,0620	0	-3	0,2574	0,6913	1,0940
7Y	0,2680	1	-3	0,4703	0,8847	1,2433
10Y	0,5650	1	-2	0,7535	1,0991	1,3883
15Y	0,9210	1	-2	1,0506	1,2880	1,4834
20Y	1,0950	1	-2	1,1888	1,3542	1,4804
30Y	1,1790	2	-2	1,2340	1,3349	1,4090

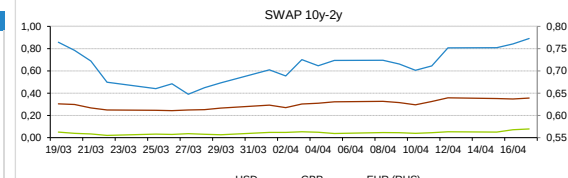
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



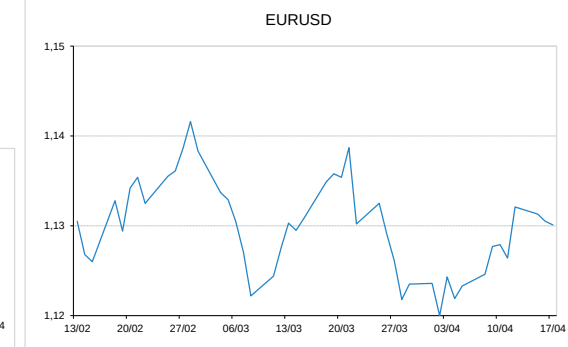
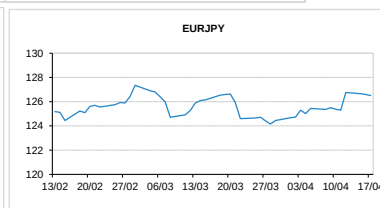
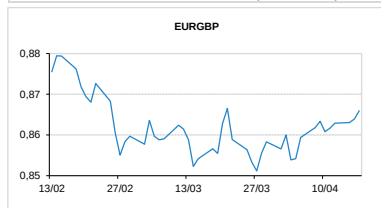
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6090	1	-4	2,3886	2,3480	2,5540
2Y	2,4970	1	-6	2,3513	2,4000	2,5975
3Y	2,4320	2	-6	2,3567	2,4405	2,6440
4Y	2,4070	2	-6	2,3858	2,5010	2,7066
5Y	2,4100	2	-5	2,4233	2,5470	2,7435
7Y	2,4550	1	-6	2,5000	2,6460	2,7770
10Y	2,5450	1	-6	2,5860	2,7308	2,8235
15Y	2,6570	1	-7	2,7097	2,7938	2,8725
20Y	2,7080	2	-7	2,7265	2,8129	2,8410
30Y	2,7280	1	-7	2,7652	2,7830	2,8170



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	71,87	0,15	4,83	OT 2Y	-0,350	0,00	-8,50
JETFUEL	669,75	0,25	28,75	OT 5Y	0,149	0,00	-5,60
DIESEL	640,25	1,50	32,00	OT 10Y	1,212	0,01	-5,00
COBRE	6.491,50	15,00	64,00	BUND 10Y	-0,320	1,97	-0,40
ZINCO	2.849,00	-88,00	49,00	SCHATZ 2Y	0,046	-0,46	-3,40
OURO	1.273,74	-0,31	-28,93	T-NOTE 10Y	3,296	-0,49	-0,30
TRIGO	450,25	1,75	-18,00	T-NOTE 2Y	2,764	-1,17	-2,40
LICENÇA C02	27,54	0,54	5,07	GILT 10Y	1,166	1,85	4,70


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1301	-0,04%	-0,42%	1,1389	1,1476	1,1652
EUR/GBP	0,86593	-0,23%	-1,08%	0,8686	0,8715	0,8778
EUR/JPY	126,51	0,06%	0,02%	126,51	126,51	126,51
EUR/CHF	1,1409	-0,31%	-0,57%	1,1399	1,1388	1,1366
EUR/BRL	4,4465	-0,96%	-3,29%	4,5106	4,5793	4,7072
EUR/PLN	4,2720	0,03%	0,41%	4,2934	4,3150	4,3601

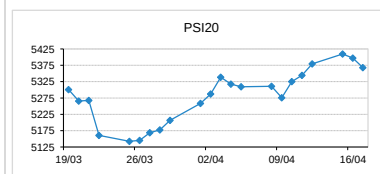

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1301	0,8659	126,51	1,1409	10,4521	7,4652	1,5073	1,57645	4,4465	9,5987
USD	0,8846	-	0,7665	111,99	1,0089	9,2350	6,6032	1,3326	1,3927	3,9258	8,4812

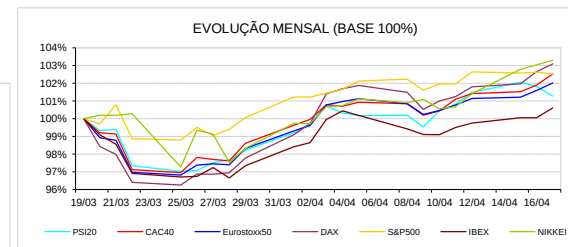
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,290	-0,95	25,69
BCP	0,250	-0,20	8,93
CORT. AMORIM	10,560	0,00	17,33
CTT	2,726	-0,29	-7,47
EDP	3,388	-0,76	11,12
EDP R	8,670	0,58	11,51
GALP	14,470	0,49	4,89
IBERSOL	7,900	-1,25	0,00
J MARTINS	14,085	0,64	36,22
MOTA ENGIL	2,298	0,35	42,73
NAVIGATOR	4,202	-2,37	16,72
NOS	6,020	-1,15	13,69
NOVABASE	2,480	-0,40	22,77
PHAROL	0,175	-1,69	7,23
REN	2,500	-1,77	2,71
SEMAPA	15,000	-1,45	14,50
SONAE CAP.	0,900	0,33	6,01
SONAE SGPS	0,950	-1,45	17,28

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
J MARTINS	0,64
EDP R	0,58
GALP	0,49
MOTA ENGIL	0,35
SONAE CAP.	0,33
SEMAPA	-1,45
SONAE SGPS	-1,45
PHAROL	-1,69
REN	-1,77
NAVIGATOR	-2,37



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.367,96	-0,54%	13,45%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.563,09	0,62%	17,60%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.477,73	0,41%	15,87%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	12.153,07	0,43%	15,10%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.904,27	-0,10%	15,85%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.549,80	0,55%	11,83%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	22.277,97	0,25%	11,31%	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.