

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

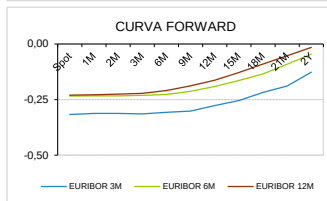
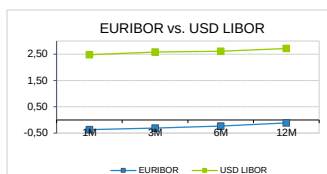
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

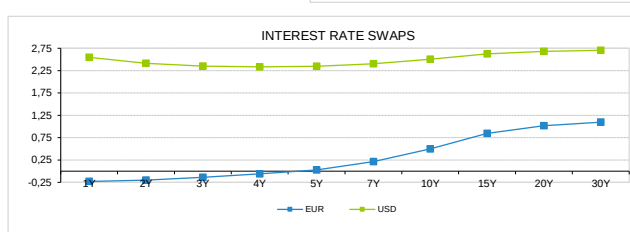
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4785	0	-1	0,7318	-0,7892
3M	-0,3100	0	0	3M	2,5824	0	-3	0,8253	-0,7142
6M	-0,2290	0	0	6M	2,6125	-1	-6	0,9400	-0,6398
12M	-0,1130	0	-1	12M	2,7163	-1	-3	1,0896	-0,5144

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2300	0	-1	-0,1628	0,1677	0,5823
2Y	-0,1990	0	-2	-0,0892	0,2650	0,6898
3Y	-0,1370	-1	-3	-0,0050	0,3722	0,7934
4Y	-0,0610	-1	-3	0,0880	0,4785	0,8910
5Y	0,0260	-2	-3	0,1860	0,5818	0,9775
7Y	0,2150	-3	-2	0,3870	0,7721	1,1279
10Y	0,4980	-3	-1	0,6610	0,9893	1,2770
15Y	0,8450	-3	0	0,9562	1,1827	1,3776
20Y	1,0170	-3	1	1,0953	1,2516	1,3771
30Y	1,0960	-3	1	1,1408	1,2355	1,3081

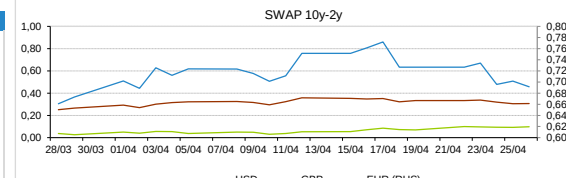
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5460	-2	-3	2,2464	2,2375	2,4670
2Y	2,4130	-4	0	2,1870	2,3020	2,5110
3Y	2,3500	-4	2	2,2045	2,3480	2,5785
4Y	2,3340	-4	4	2,2380	2,4010	2,6130
5Y	2,3460	-4	6	2,2815	2,4500	2,6723
7Y	2,4030	-4	7	2,3750	2,5355	2,7299
10Y	2,5040	-4	8	2,5167	2,6290	2,7490
15Y	2,6250	-4	8	2,6030	2,7010	2,7830
20Y	2,6790	-4	8	2,6540	2,7170	2,7740
30Y	2,7040	-4	9	2,6700	2,7140	2,7465

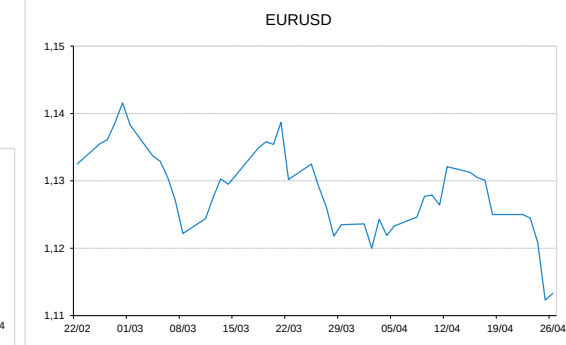
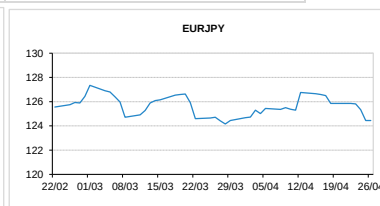
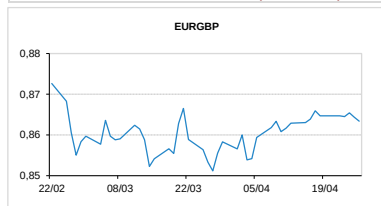


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	72,06	-2,29	4,63	OT 2Y	-0,349	-0,01	-4,40
JETFUEL	658,92	-22,33	11,79	OT 5Y	0,102	-0,04	-8,20
DIESEL	628,17	-21,83	15,79	OT 10Y	1,130	-0,06	-12,90
COBRE	6 346,00	-83,00	25,00	BUND 10Y	-0,429	-0,01	5,40
ZINCO	2 808,00	8,50	-48,50	SCHATZ 2Y	0,023	-0,23	1,80
OURO	1 287,69	10,54	-28,00	T-NOTE 10Y	3,213	-2,92	10,40
TRIGO	444,25	2,75	-30,25	T-NOTE 2Y	2,652	-4,46	10,90
LICENÇA C02	25,72	-1,56	4,18	GILT 10Y	1,067	-1,19	14,50



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1133	0,09%	-1,40%	1,1221	1,1305	1,1471
EUR/GBP	0,8634	0,11%	-1,17%	0,8661	0,8689	0,8750
EUR/JPY	124,45	0,00%	0,22%	124,45	124,45	124,45
EUR/CHF	1,1367	-0,07%	-1,44%	1,1357	1,1345	1,1322
EUR/BRL	4,3786	0,48%	-0,26%	4,4471	4,5173	4,6495
EUR/PLN	4,2927	-0,02%	-0,04%	4,3146	4,3361	4,3791



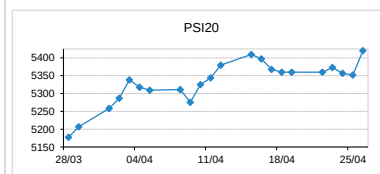
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1133	0,8634	124,45	1,1367	10,5907	7,4653	1,5015	1,58336	4,3786	9,6758
USD	0,8958	-	0,7731	111,535	1,0194	9,4900	6,6870	1,3467	1,4196	3,9270	8,6689

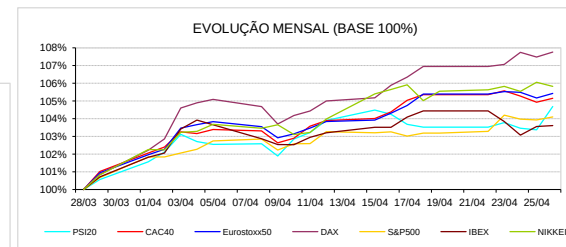
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,190	1,91	23,97
BCP	0,248	1,06	8,24
CORT. AMORIM	10,540	0,43	17,11
CTT	2,712	-0,07	-7,94
EDP	3,385	0,45	11,02
EDP R	8,880	0,00	14,21
GALP	14,985	-0,23	8,63
IBERSOL	7,900	0,00	0,00
J MARTINS	14,795	6,59	43,09
MOTA ENGIL	2,410	1,18	49,69
NAVIGATOR	3,966	0,66	10,17
NOS	6,030	1,01	13,88
NOVABASE	2,500	-0,79	23,76
PHAROL	0,161	-1,47	-1,35
REN	2,535	0,60	4,15
SEMAPA	14,860	1,09	13,44
SONAE CAP.	0,915	0,22	7,77
SONAE SGPS	0,987	0,46	21,79

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
J MARTINS	6,59
ALTRI	1,91
MOTA ENGIL	1,18
SEMAPA	1,09
BCP	1,06
CTT	-0,07
GALP	-0,23
NOVABASE	-0,79
PHAROL	-1,47



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5 420,07	1,28%	14,55%	5 801,45	4 551,84
CAC40	5 569,36	0,21%	17,73%	5 657,44	4 555,99
ESTX 50 PR	3 500,41	0,24%	16,63%	3 596,20	2 908,70
XTRA DAX	12 315,18	0,27%	16,63%	13 204,31	10 279,20
S&P 500	2 930,78	0,16%	16,91%	2 940,91	2 346,58
IBEX 35	9 506,00	0,05%	11,31%	10 291,40	8 286,20
NIKKEI 225	22 258,73	-0,22%	11,21%	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.