

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

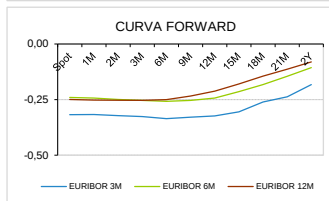
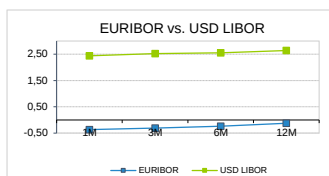
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

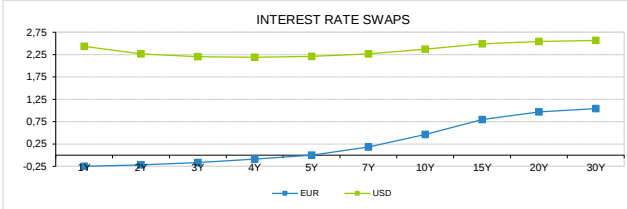
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3660	0	0	1M	2,4376	0	-4	0,7311	-0,7950
3M	-0,3110	0	0	3M	2,5245	1	-8	0,8046	-0,7106
6M	-0,2350	0	0	6M	2,5509	-4	-9	0,9095	-0,6572
12M	-0,1250	0	-1	12M	2,6393	-3	-11	1,0545	-0,5136

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2490	-1	-2	-0,2139	0,1039	0,5053
2Y	-0,2180	-1	-1	-0,1462	0,2065	0,6077
3Y	-0,1640	-1	-2	-0,0627	0,3060	0,7090
4Y	-0,0870	-1	-2	0,0307	0,4062	0,8000
5Y	-0,0020	0	-3	0,1249	0,5063	0,8850
7Y	0,1820	-1	-4	0,3188	0,6890	1,0270
10Y	0,4610	-1	-5	0,5849	0,8993	1,1710
15Y	0,7970	-2	-6	0,8693	1,0877	1,2700
20Y	0,9670	-2	-6	1,0052	1,1552	1,2690
30Y	1,0420	-2	-7	1,0469	1,1357	1,2000

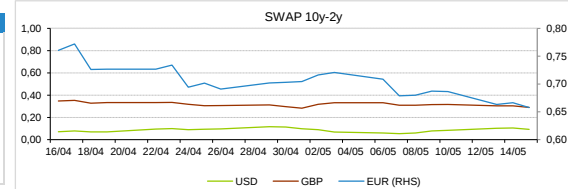
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



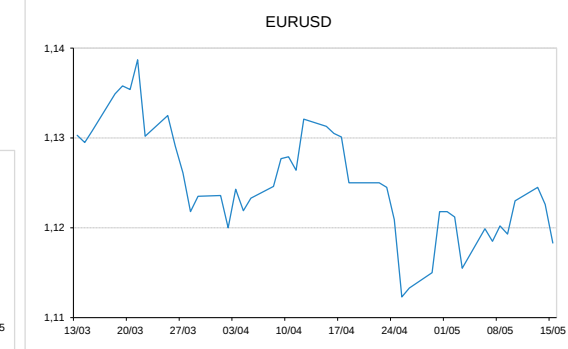
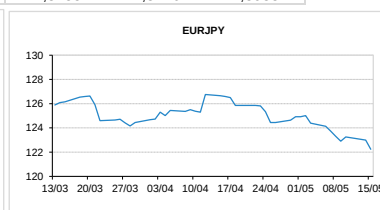
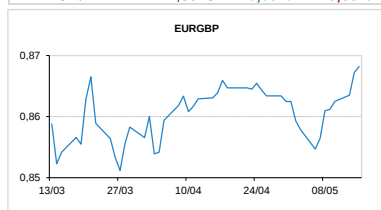
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,4340	-5	-17	2,0671	2,1259	2,3275
2Y	2,2660	-7	-22	2,0501	2,1625	2,3700
3Y	2,2020	-6	-21	2,0726	2,1940	2,4200
4Y	2,1900	-7	-20	2,0890	2,2857	2,4640
5Y	2,2080	-5	-19	2,1582	2,3343	2,5260
7Y	2,2670	-5	-17	2,2488	2,3980	2,5405
10Y	2,3710	-4	-16	2,3485	2,5093	2,6070
15Y	2,4890	-3	-16	2,4590	2,5766	2,6225
20Y	2,5420	-3	-15	2,5060	2,5760	2,6130
30Y	2,5660	-3	-15	2,5255	2,5750	2,6090



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	71,94	0,70	1,20	OT 2Y	-0,337	-0,01	0,80
JETFUEL	676,25	1,75	9,31	OT 5Y	0,096	-0,01	-6,30
DIESEL	644,50	0,75	6,75	OT 10Y	1,126	-0,01	-7,00
COBRE	6.043,50	16,00	-457,00	BUND 10Y	-0,509	-2,51	-16,40
ZINCO	2.644,25	27,25	-301,75	SCHATZ 2Y	-0,028	-1,38	-8,30
OURO	1.296,22	0,30	6,73	T-NOTE 10Y	3,118	-2,73	-14,90
TRIGO	458,50	10,00	-4,75	T-NOTE 2Y	2,565	-2,52	-18,80
LICENÇA C02	25,96	0,07	-0,85	GILT 10Y	0,988	-2,92	-16,20


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1183	-0,38%	-1,15%	1,1271	1,1354	1,1517
EUR/GBP	0,8682	-0,11%	-0,59%	0,8709	0,8738	0,8800
EUR/JPY	122,24	0,62%	3,62%	122,24	122,24	122,24
EUR/CHF	1,1311	0,02%	0,35%	1,1299	1,1289	1,1268
EUR/BRL	4,4684	-0,30%	-2,04%	4,5402	4,6068	4,7368
EUR/PLN	4,3028	0,09%	-0,69%	4,3255	4,3476	4,3938

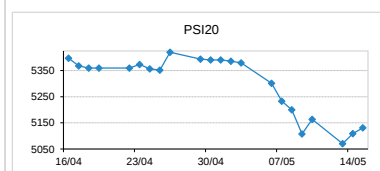

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1183	0,8682	122,24	1,1311	10,7612	7,4686	1,5054	1,61756	4,4684	9,7726
USD	0,8923	-	0,7773	109,495	1,0085	9,6023	6,6621	1,3451	1,4425	3,9977	8,7212

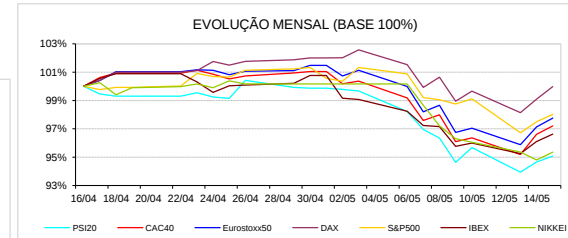
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,280	-0,08	8,28
BCP	0,252	0,36	9,98
CORT. AMORIM	10,220	0,39	13,56
CTT	2,204	2,61	-25,19
EDP	3,157	0,10	3,54
EDP R	8,720	0,93	12,15
GALP	14,000	0,50	1,49
IBERSOL	8,060	-0,98	2,03
J MARTINS	13,670	0,66	32,21
MOTA ENGIL	2,134	1,14	32,55
NAVIGATOR	3,456	-0,06	-4,00
NOS	5,780	0,78	9,16
NOVABASE	2,510	0,40	24,26
PHAROL	0,158	0,25	-3,43
RAMADA	7,620	-0,26	1,60
REN	13,040	-0,46	-0,46
SEMAPA	0,861	-0,35	1,41
SONAE CAP.	0,960	1,96	18,52
SONAE SGPS	7,620	-0,26	1,60

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	2,61
SONAE CAP.	1,96
MOTA ENGIL	1,14
EDP R	0,93
NOS	0,78
RAMADA	-0,26
RAMADA	-0,26
SEMAPA	-0,35
REN	-0,46
IBERSOL	-0,98



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.131,37	0,44%	8,45%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.374,26	0,62%	13,60%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.385,78	0,64%	12,81%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	12.099,57	0,90%	14,59%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.849,62	0,53%	13,67%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.177,10	0,54%	7,46%	10.221,00	8.286,20
NIKKEI 225	21.188,56	0,58%	5,86%	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.