

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

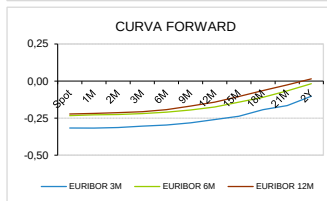
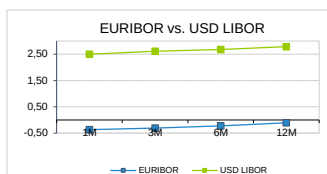
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

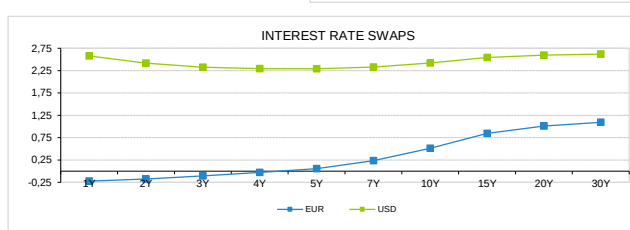
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4989	1	1	0,7279	-0,7854
3M	-0,3100	0	0	3M	2,6099	1	-4	0,8304	-0,7130
6M	-0,2280	0	0	6M	2,6760	0	-3	0,9379	-0,6516
12M	-0,1080	0	0	12M	2,7870	-1	-10	1,0555	-0,5084

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2220	0	-1	-0,1440	0,1980	0,5670
2Y	-0,1770	-1	-2	-0,0641	0,2890	0,6570
3Y	-0,1070	-1	-4	0,0228	0,3785	0,7550
4Y	-0,0270	-2	-6	0,1117	0,4710	0,8480
5Y	0,0570	-2	-8	0,2009	0,5669	0,9310
7Y	0,2360	-3	-11	0,3853	0,7460	1,0710
10Y	0,5110	-4	-14	0,6433	0,9507	1,2100
15Y	0,8440	-7	-16	0,9203	1,1330	1,3030
20Y	1,0090	-8	-16	1,0470	1,1947	1,3067
30Y	1,0930	-8	-14	1,0973	1,1861	1,2500

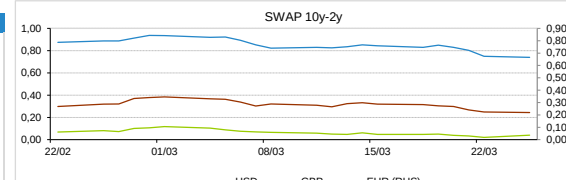
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5780	-4	-9	2,1439	2,0870	2,3370
2Y	2,4170	-8	-19	2,0937	2,1590	2,3880
3Y	2,3270	-9	-23	2,0710	2,2190	2,4440
4Y	2,2930	-10	-25	2,1349	2,2710	2,4890
5Y	2,2910	-10	-25	2,1640	2,3260	2,5541
7Y	2,3290	-10	-26	2,2490	2,4200	2,6211
10Y	2,4210	-11	-25	2,3750	2,5230	2,6745
15Y	2,5430	-11	-23	2,5174	2,6146	2,6860
20Y	2,5960	-11	-22	2,5510	2,6425	2,7014
30Y	2,6190	-11	-20	2,5730	2,6190	2,6540

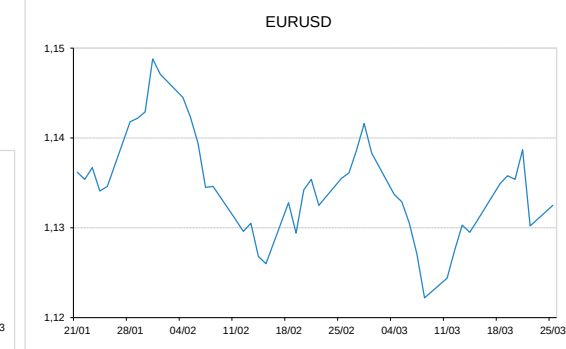
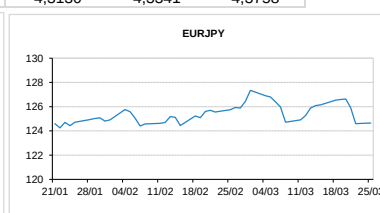


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	67,19	0,16	2,28	OT 2Y	-0,270	0,00	-4,00
JETFUEL	646,00	9,00	6,25	OT 5Y	0,220	0,02	-11,90
DIESEL	610,25	8,50	-1,75	OT 10Y	1,295	0,03	-21,70
COBRE	6.325,00	-109,00	-166,00	BUND 10Y	-0,429	-0,65	-16,90
ZINCO	2.846,00	-23,50	105,00	SCHATZ 2Y	0,046	0,00	-2,70
OURO	1.321,89	8,98	-4,46	T-NOTE 10Y	3,141	-3,54	-22,40
TRIGO	469,75	3,75	-3,00	T-NOTE 2Y	2,582	-6,78	-26,20
LICENÇA C02	20,77	0,10	1,53	GILT 10Y	0,905	-2,81	-24,50



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1325	0,20%	-0,26%	1,1413	1,1498	1,1663
EUR/GBP	0,85638	0,29%	1,39%	0,8591	0,8619	0,8674
EUR/JPY	124,65	-0,04%	0,88%	124,65	124,65	124,65
EUR/CHF	1,1228	0,00%	1,15%	1,1218	1,1207	1,1184
EUR/BRL	4,3812	0,79%	-2,82%	4,4440	4,5153	4,6475
EUR/PLN	4,2920	0,15%	1,06%	4,3130	4,3341	4,3758



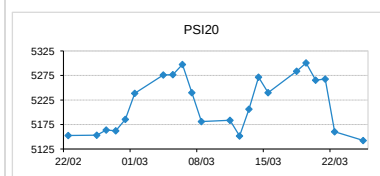
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1325	0,8564	124,65	1,1228	10,4524	7,4642	1,5183	1,59123	4,3812	9,6570
USD	0,8833	-	0,7569	110,065	0,9923	9,2280	6,5930	1,3429	1,4077	3,8619	8,5393

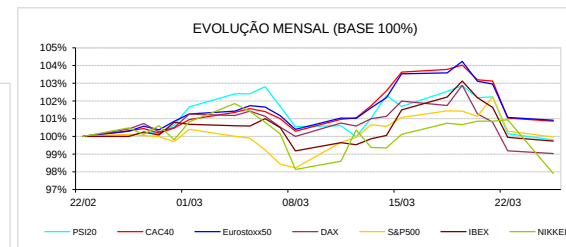
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,980	-0,14	20,34
BCP	0,223	0,63	-2,88
CORT. AMORIM	10,540	-0,94	17,11
CTT	2,620	-0,91	-11,07
EDP	3,445	0,44	12,99
EDP R	8,520	-0,23	9,58
GALP	13,855	0,14	0,43
IBERSOL	8,000	1,01	1,27
J MARTINS	13,135	-0,94	27,03
MOTA ENGIL	2,055	-1,91	27,64
NAVIGATOR	4,050	-0,54	12,50
NOS	5,560	-0,54	5,00
NOVABASE	2,510	-0,79	24,26
PHAROL	0,190	-2,86	16,67
REN	2,568	-0,47	5,51
SEMAPA	14,540	-0,95	10,99
SONAE CAP.	0,881	-1,23	3,77
SONAE SGPS	0,911	-1,83	12,47

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	1,01
BCP	0,63
EDP	0,44
GALP	0,14
SEMAPA	-0,95
SONAE CAP.	-1,23
SONAE SGPS	-1,83
MOTA ENGIL	-1,91
PHAROL	-2,86



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.142,45	-0,35%	8,69%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.260,64	-0,18%	11,20%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.300,48	-0,16%	9,96%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.346,65	-0,15%	7,46%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.792,60	-0,32%	11,36%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.179,90	-0,21%	7,49%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.977,11	-3,01%	4,81%	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.