

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

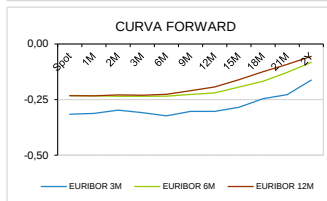
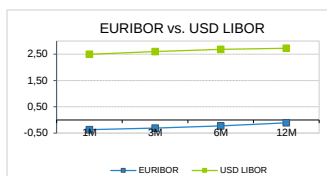
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

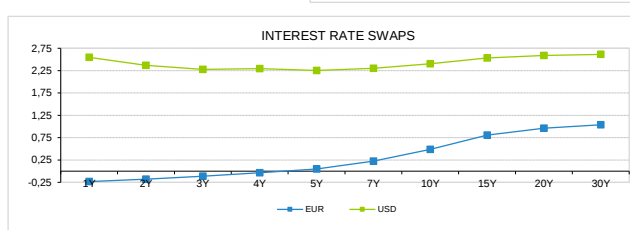
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4955	1	0	0,7311
3M	-0,3090	0	0	3M	2,5974	-1	-3	0,8363
6M	-0,2270	0	0	6M	2,6821	1	0	0,9484
12M	-0,1090	0	0	12M	2,7246	-2	-15	1,0611

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2325	-1	-2	-0,1935	0,1100	0,4984
2Y	-0,1790	0	-3	-0,1261	0,2055	0,6030
3Y	-0,1130	-1	-4	-0,0465	0,3035	0,7090
4Y	-0,0340	-1	-6	0,0403	0,4035	0,8050
5Y	0,0500	-1	-7	0,1319	0,5065	0,8910
7Y	0,2240	-1	-11	0,3253	0,6930	1,0427
10Y	0,4890	-2	-15	0,5919	0,9037	1,1670
15Y	0,8060	-4	-19	0,8707	1,0831	1,2600
20Y	0,9620	-4	-20	1,0002	1,1476	1,2610
30Y	1,0380	-5	-19	1,0472	1,1355	1,2000

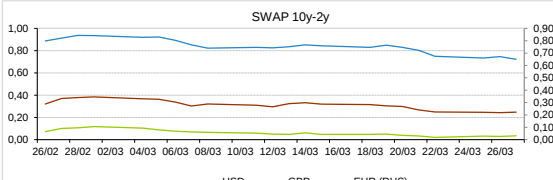
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5480	-3	-12	2,1097	2,0870	2,2980
2Y	2,3670	-5	-24	2,0530	2,1465	2,3420
3Y	2,2760	-5	-28	2,0530	2,1990	2,3870
4Y	2,2930	-10	-25	2,0920	2,2440	2,4340
5Y	2,2530	-4	-29	2,1320	2,2920	2,4987
7Y	2,3000	-3	-29	2,2000	2,3770	2,5430
10Y	2,4030	-2	-28	2,3335	2,4960	2,6000
15Y	2,5310	-1	-26	2,4735	2,5405	2,6315
20Y	2,5870	-1	-25	2,4750	2,5730	2,6210
30Y	2,6120	-1	-23	2,5145	2,5535	2,5950

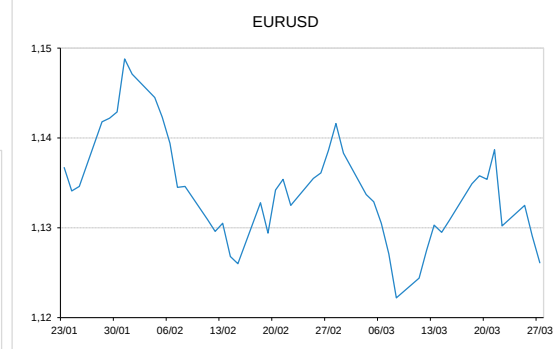
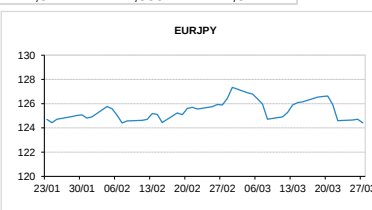


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	67,78	-0,19	1,20	OT 2Y	-0,305	-0,02	-5,90
JETFUEL	646,25	-0,88	-7,50	OT 5Y	0,184	-0,04	-11,70
DIESEL	611,75	-0,63	-18,00	OT 10Y	1,259	-0,03	-20,70
COBRE	6.351,50	-10,00	-163,00	BUND 10Y	-0,476	-6,48	-19,00
ZINCO	2.915,00	45,50	157,00	SCHATZ 2Y	0,009	-4,59	-6,40
OURO	1.312,01	-3,68	-7,40	T-NOTE 10Y	3,107	-3,05	-24,30
TRIGO	468,25	-1,00	1,50	T-NOTE 2Y	2,532	-5,22	-28,50
LICENÇA C02	21,86	0,32	0,59	GILT 10Y	0,935	0,54	-17,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1261	-0,27%	-1,10%	1,1347	1,1434	1,1598
EUR/GBP	0,85118	0,25%	0,45%	0,8539	0,8567	0,8625
EUR/JPY	124,42	0,24%	1,19%	124,42	124,42	124,42
EUR/CHF	1,1193	0,16%	1,68%	1,1182	1,1171	1,1148
EUR/BRL	4,4433	-1,72%	-4,56%	4,5067	4,5798	4,7174
EUR/PLN	4,2917	0,04%	0,56%	4,3121	4,3337	4,3772



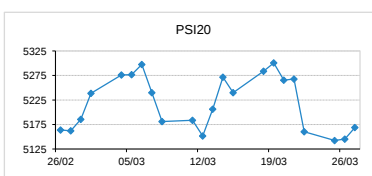
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1261	0,8512	124,42	1,1193	10,4423	7,4667	1,5111	1,58992	4,4433	9,7208
USD	0,8887	-	0,7574	110,375	0,9951	9,2701	6,6353	1,3417	1,4123	3,9493	8,6264

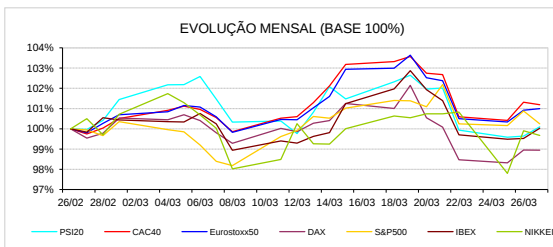
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,840	1,18	17,93
BCP	0,229	3,81	-0,17
CORT. AMORIM	10,660	0,95	18,44
CTT	2,550	-1,47	-13,44
EDP	3,490	0,43	14,46
EDP R	8,400	-0,36	8,04
GALP	14,180	0,75	2,79
IBERSOL	7,820	-3,22	-1,01
J MARTINS	12,910	-1,45	24,85
MOTA ENGIL	2,030	-1,22	26,09
NAVIGATOR	4,026	0,15	11,83
NOS	5,645	-0,35	6,61
NOVABASE	2,510	-0,40	24,26
PHAROL	0,191	2,25	16,79
REN	2,540	-0,55	4,35
SEMAPA	14,480	0,70	10,53
SONAE CAP.	0,880	0,34	3,65
SONAE SGPS	0,934	1,85	15,31

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	3,81
PHAROL	2,25
SONAE SGPS	1,85
ALTRI	1,18
CORT. AMORIM	0,95
REN	-0,55
MOTA ENGIL	-1,22
J MARTINS	-1,45
CTT	-1,47
IBERSOL	-3,22



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.168,79	0,46%	9,24%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.301,24	-0,12%	12,06%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.322,04	0,08%	10,68%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.419,04	0,00%	8,15%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.800,81	-0,63%	11,73%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.229,90	0,51%	8,08%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.378,73	-0,23%	6,81%	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.