

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

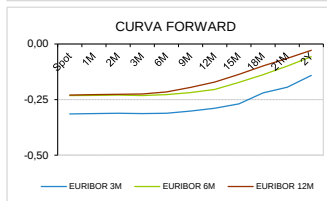
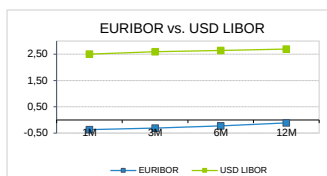
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

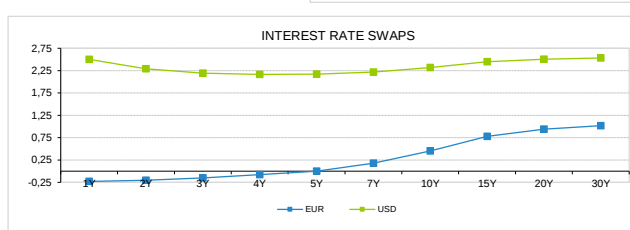
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,5015	0	1	0,7308	-0,7840
3M	-0,3110	0	0	3M	2,5918	-1	-2	0,8333	-0,7066
6M	-0,2280	0	0	6M	2,6411	-1	-4	0,9583	-0,6472
12M	-0,1120	0	0	12M	2,6943	1	-17	1,0619	-0,5010

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,2300	0	-2	-0,1740	0,1480	0,5452	
2Y	-0,2040	-2	-6	-0,1018	0,2410	0,6522	
3Y	-0,1500	-3	-10	-0,0116	0,3403	0,7549	
4Y	-0,0790	-4	-13	0,0748	0,4440	0,8510	
5Y	0,0010	-4	-16	0,1682	0,5524	0,9370	
7Y	0,1790	-3	-20	0,3614	0,7365	1,0880	
10Y	0,4520	-1	-24	0,6337	0,9590	1,2360	
15Y	0,7790	1	-27	0,9293	1,1528	1,3330	
20Y	0,9400	2	-27	1,0629	1,2163	1,3340	
30Y	1,0180	3	-26	1,1119	1,2047	1,2720	

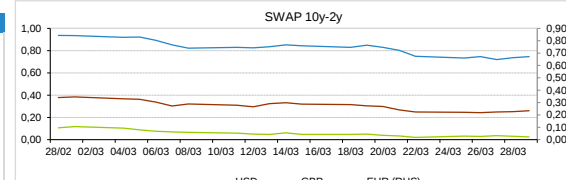
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5010	-4	-16	2,2362	2,1910	2,3710
2Y	2,2900	-8	-30	2,1600	2,2320	2,4135
3Y	2,1920	-8	-34	2,1610	2,2760	2,4560
4Y	2,1650	-13	-36	2,2149	2,3190	2,4940
5Y	2,1720	-8	-36	2,2472	2,3630	2,5512
7Y	2,2170	-8	-37	2,3015	2,4390	2,5855
10Y	2,3170	-8	-37	2,4060	2,5245	2,6335
15Y	2,4470	-8	-35	2,5085	2,5920	2,6635
20Y	2,5040	-8	-33	2,5540	2,6090	2,6560
30Y	2,5320	-7	-31	2,5620	2,6188	2,6270

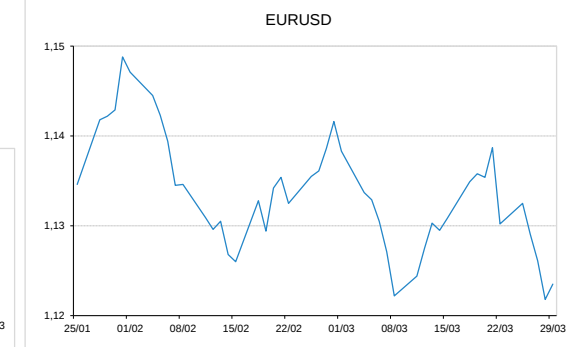
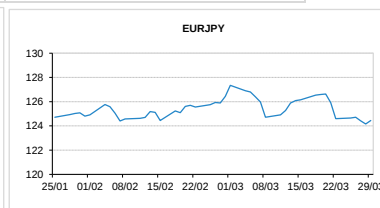


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	67,57	0,47	1,24	OT 2Y	-0,309	0,00	-5,90
JETFUEL	641,40	1,65	-13,60	OT 5Y	0,167	-0,01	-12,40
DIESEL	610,00	4,25	-20,73	OT 10Y	1,251	-0,02	-20,00
COBRE	6.366,50	25,00	-149,00	BUND 10Y	-0,468	0,14	-23,50
ZINCO	2.909,00	-21,00	109,50	SCHATZ 2Y	0,011	-0,69	-7,60
OURO	1.294,77	3,68	-20,48	T-NOTE 10Y	3,155	2,73	-21,00
TRIGO	455,50	-9,00	-4,00	T-NOTE 2Y	2,617	5,23	-20,20
LICENÇA C02	21,57	-0,69	-0,12	GILT 10Y	0,921	-0,63	-30,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1235	0,15%	-1,59%	1,1322	1,1407	1,1574
EUR/GBP	0,8583	-0,32%	0,01%	0,8610	0,8638	0,8696
EUR/JPY	124,45	-0,23%	1,60%	124,45	124,45	124,45
EUR/CHF	1,1175	0,07%	1,60%	1,1165	1,1154	1,1132
EUR/BRL	4,3714	0,24%	-2,25%	4,4339	4,5051	4,6367
EUR/PLN	4,3059	-0,23%	-0,05%	4,3267	4,3482	4,3922



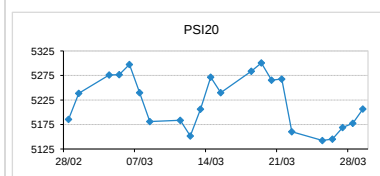
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1235	0,8583	124,45	1,1175	10,4101	7,4653	1,5005	1,58075	4,3714	9,6685
USD	0,8907	-	0,7692	110,845	0,9957	9,2725	6,6495	1,3360	1,4109	3,8974	8,6241

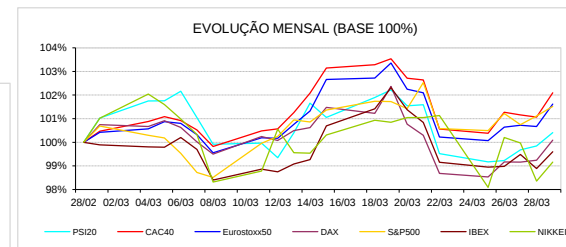
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,980	1,01	20,34
BCP	0,230	0,35	0,35
CORT. AMORIM	10,640	-0,56	18,22
CTT	2,580	0,78	-12,42
EDP	3,505	0,03	14,96
EDP R	8,500	0,71	9,32
GALP	14,280	1,06	3,52
IBERSOL	7,740	0,26	-2,03
J MARTINS	13,150	1,19	27,18
MOTA ENGIL	2,040	0,99	26,71
NAVIGATOR	4,080	0,99	13,33
NOS	5,700	0,80	7,65
NOVABASE	2,500	0,00	23,76
PHAROL	0,193	0,73	18,26
REN	2,542	0,08	4,44
SEMAPA	14,520	0,69	10,84
SONAE CAP.	0,875	0,00	3,06
SONAE SGPS	0,922	-0,43	13,83

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
J MARTINS	1,19
GALP	1,06
ALTRI	1,01
MOTA ENGIL	0,99
MOTA ENGIL	0,99
SONAE SGPS	-0,43
CORT. AMORIM	-0,56



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.206,61	0,56%	10,04%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.350,53	1,02%	13,10%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.351,71	0,95%	11,67%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.526,04	0,86%	9,16%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.826,06	0,39%	12,75%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.240,30	0,72%	8,20%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.205,81	0,82%	5,95%	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.