

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

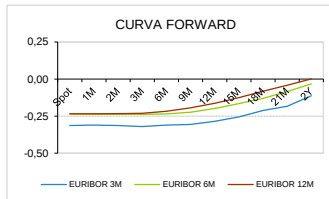
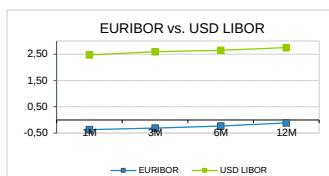
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

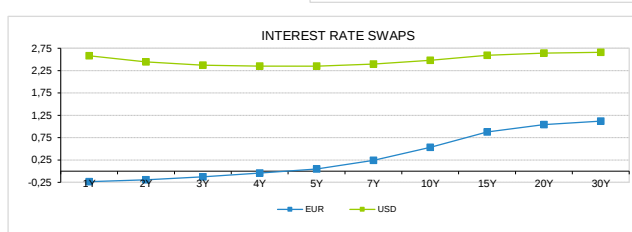
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4716	0	-1	0,7315	-0,7888
3M	-0,3100	0	0	3M	2,5921	0	-1	0,8185	-0,7146
6M	-0,2310	0	0	6M	2,6446	0	-4	0,9469	-0,6516
12M	-0,1120	0	0	12M	2,7511	1	-13	1,0761	-0,4990

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2345	0	-1	-0,1655	0,1969	0,6130
2Y	-0,1950	0	-6	-0,0808	0,3012	0,7200
3Y	-0,1270	0	-8	0,0116	0,4052	0,8270
4Y	-0,0430	0	-10	0,1106	0,5110	0,9270
5Y	0,0480	1	-12	0,2106	0,6154	1,0145
7Y	0,2420	1	-14	0,4145	0,8086	1,1590
10Y	0,5320	1	-17	0,6927	1,0209	1,3010
15Y	0,8760	0	-18	0,9811	1,2057	1,3926
20Y	1,0430	-1	-18	1,1144	1,2704	1,3873
30Y	1,1200	-2	-18	1,1563	1,2513	1,3207

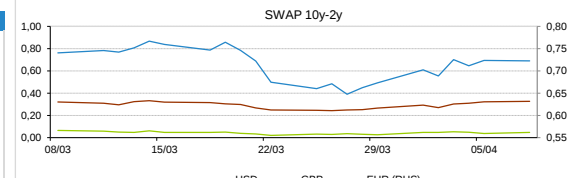
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5810	0	-10	2,3181	2,2470	2,4600
2Y	2,4460	0	-21	2,2400	2,3040	2,4970
3Y	2,3710	-1	-24	2,2480	2,3515	2,5600
4Y	2,3510	3	-23	2,2695	2,4306	2,6192
5Y	2,3490	-1	-25	2,3369	2,4754	2,6551
7Y	2,3940	-2	-26	2,4152	2,5507	2,7143
10Y	2,4810	-2	-26	2,5005	2,6115	2,7370
15Y	2,5920	-2	-26	2,6258	2,7091	2,7887
20Y	2,6410	-2	-25	2,6695	2,7281	2,7560
30Y	2,6590	-2	-25	2,6610	2,6980	2,7300

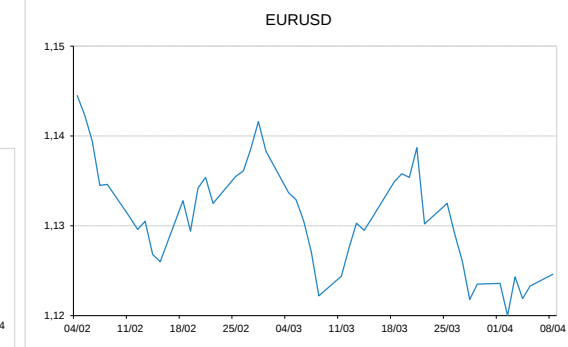
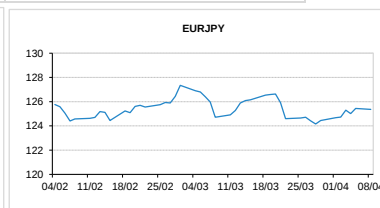
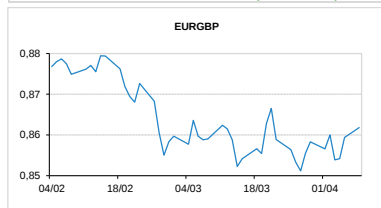


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	71,05	0,71	5,39	OT 2Y	-0,320	0,00	-3,90
JETFUEL	663,67	8,26	23,98	OT 5Y	0,155	-0,02	-6,00
DIESEL	631,17	7,51	21,23	OT 10Y	1,225	-0,03	-11,70
COBRE	6.397,50	-50,00	-77,00	BUND 10Y	-0,396	-0,07	-6,00
ZINCO	2.974,00	22,00	175,00	SCHATZ 2Y	0,034	-0,69	-3,00
OURO	1.297,69	5,98	-0,46	T-NOTE 10Y	3,230	0,81	-8,90
TRIGO	469,50	1,75	30,00	T-NOTE 2Y	2,704	0,78	-10,70
LICENÇA C02	24,38	-0,22	1,36	GILT 10Y	1,036	-0,73	-5,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1246	0,12%	0,21%	1,1333	1,1420	1,1596
EUR/GBP	0,86183	-0,28%	-0,32%	0,8645	0,8673	0,8734
EUR/JPY	125,36	0,06%	-0,51%	125,36	125,36	125,36
EUR/CHF	1,1255	-0,30%	0,61%	1,1244	1,1234	1,1211
EUR/BRL	4,344	0,08%	-0,06%	4,4098	4,4803	4,6124
EUR/PLN	4,2876	0,04%	0,31%	4,3091	4,3310	4,3765



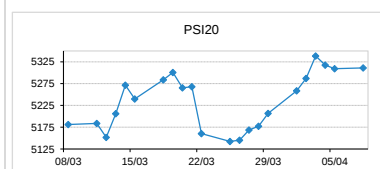
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1246	0,8618	125,36	1,1255	10,4205	7,4651	1,4996	1,58082	4,3440	9,6267
USD	0,8879	-	0,7665	111,385	0,9991	9,2551	6,6286	1,3326	1,4040	3,8710	8,5538

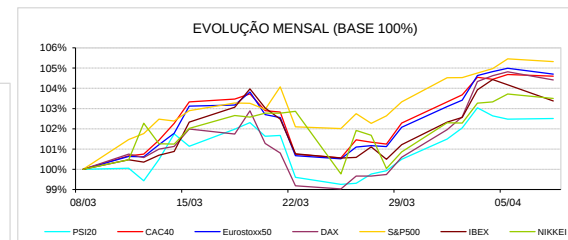
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,275	0,41	25,43
BCP	0,240	-0,66	4,58
CORT. AMORIM	10,180	-1,93	13,11
CTT	2,622	0,54	-11,00
EDP	3,515	0,20	15,28
EDP R	8,560	0,82	10,10
GALP	14,355	1,45	4,06
IBERSOL	8,040	1,01	1,77
J MARTINS	13,560	-0,66	31,14
MOTA ENGIL	2,282	0,18	41,74
NAVIGATOR	4,158	-0,05	15,50
NOS	5,950	-0,50	12,37
NOVABASE	2,470	-0,40	22,28
PHAROL	0,186	0,11	14,09
REN	2,545	0,00	4,56
SEMAPA	14,660	0,83	11,91
SONAE CAP.	0,898	2,28	5,77
SONAE SGPS	0,935	-0,16	15,37

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE CAP.	2,28
GALP	1,45
IBERSOL	1,01
SEMAPA	0,83
EDP R	0,82
NOVABASE	-0,40
NOS	-0,50
J MARTINS	-0,66
BCP	-0,66
CORT. AMORIM	-1,93



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.310,95	0,03%	12,25%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.471,78	-0,08%	15,67%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.438,06	-0,27%	14,55%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.963,40	-0,39%	13,30%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.888,83	-0,13%	15,24%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.437,70	-0,76%	10,51%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.761,65	-0,21%	8,73%	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.