

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

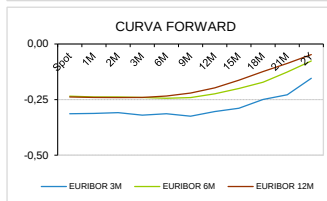
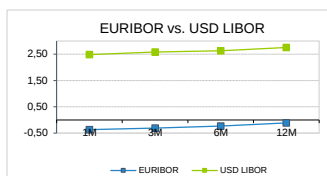
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

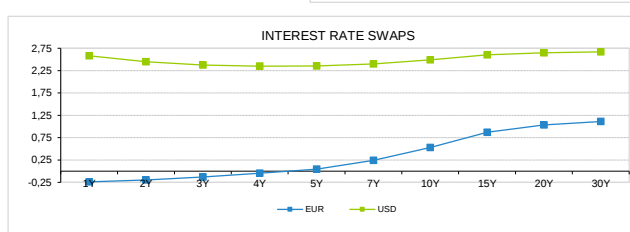
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4840	0	-1	0,7288	-0,7894
3M	-0,3100	0	0	3M	2,5813	0	-2	0,8218	-0,7152
6M	-0,2310	0	0	6M	2,6285	0	-5	0,9373	-0,6524
12M	-0,1120	0	0	12M	2,7541	0	-11	1,0679	-0,5004

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2387	0	-1	-0,1987	0,1410	0,5767
2Y	-0,1960	0	-1	-0,1221	0,2506	0,6868
3Y	-0,1300	0	-2	-0,0328	0,3591	0,7920
4Y	-0,0450	0	-2	0,0648	0,4676	0,8972
5Y	0,0470	1	-2	0,1633	0,5720	0,9863
7Y	0,2410	1	-3	0,3727	0,7720	1,1331
10Y	0,5290	1	-3	0,6540	0,9877	1,2786
15Y	0,8700	1	-5	0,9501	1,1779	1,3700
20Y	1,0360	1	-6	1,0872	1,2456	1,3652
30Y	1,1110	1	-6	1,1325	1,2280	1,3014

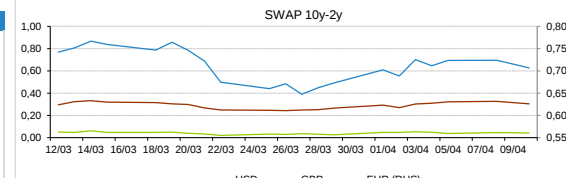
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5800	0	-8	2,2675	2,2154	2,4345
2Y	2,4470	0	-14	2,1900	2,2630	2,4875
3Y	2,3740	0	-16	2,1940	2,3020	2,5475
4Y	2,3490	0	-16	2,2175	2,3565	2,5710
5Y	2,3530	0	-16	2,2851	2,4220	2,6280
7Y	2,4000	1	-16	2,3716	2,5005	2,6680
10Y	2,4890	1	-17	2,4655	2,5950	2,7150
15Y	2,6010	1	-18	2,5750	2,6620	2,7410
20Y	2,6500	1	-17	2,6070	2,6800	2,7240
30Y	2,6690	1	-17	2,6265	2,6969	2,7320

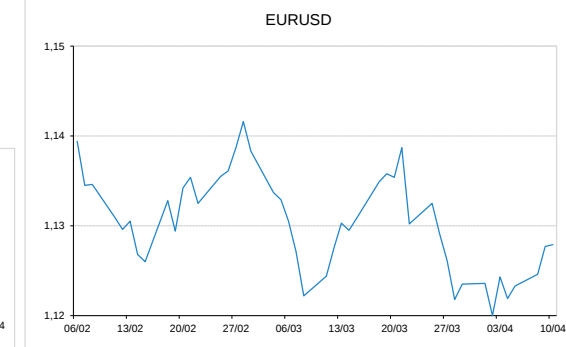
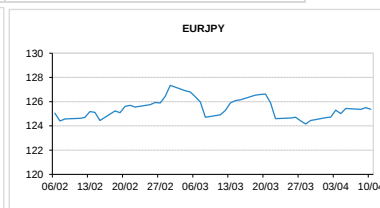
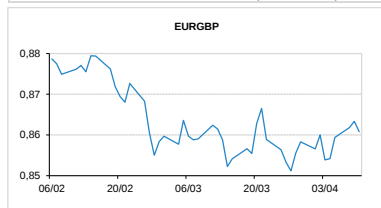


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	71,35	0,74	5,69	OT 2Y	-0,335	0,00	-6,80
JETFUEL	661,10	-2,57	21,41	OT 5Y	0,126	-0,02	-8,50
DIESEL	629,60	-1,57	19,66	OT 10Y	1,167	-0,03	-15,00
COBRE	6,487,00	12,00	92,00	BUND 10Y	-0,432	-2,81	-9,70
ZINCO	2,913,00	-42,00	190,50	SCHATZ 2Y	0,025	-1,84	-4,60
OURO	1,308,06	3,71	9,91	T-NOTE 10Y	3,199	-1,78	-12,20
TRIGO	459,00	-0,50	19,50	T-NOTE 2Y	2,673	-2,13	-14,00
LICENÇA C02	26,00	0,47	2,98	GILT 10Y	1,015	-1,92	-8,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1279	0,02%	0,31%	1,1366	1,1455	1,1626
EUR/GBP	0,86083	0,29%	0,18%	0,8635	0,8664	0,8723
EUR/JPY	125,38	0,10%	-0,37%	125,38	125,38	125,38
EUR/CHF	1,1289	-0,15%	0,69%	1,1278	1,1267	1,1245
EUR/BRL	4,3122	0,67%	0,17%	4,3766	4,4455	4,5729
EUR/PLN	4,2803	0,15%	0,50%	4,3015	4,3235	4,3670



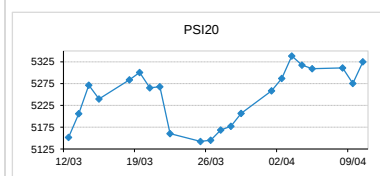
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1279	0,8608	125,38	1,1289	10,4358	7,4656	1,5009	1,57417	4,3122	9,5777
USD	0,8888	-	0,7639	110,945	1,0026	9,2826	6,6356	1,3332	1,4001	3,8283	8,5157

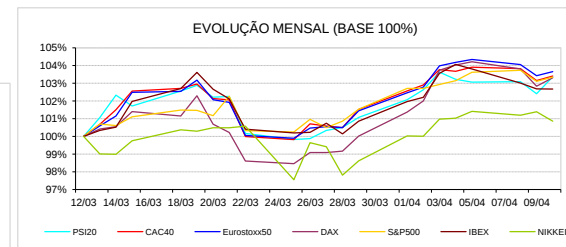
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,160	0,42	23,45
BCP	0,236	-0,51	2,92
CORT. AMORIM	10,300	1,78	14,44
CTT	2,640	0,84	-10,39
EDP	3,470	-0,09	13,81
EDP R	8,730	2,83	12,28
GALP	14,610	1,63	5,91
IBERSOL	8,040	0,00	1,77
J MARTINS	13,830	2,79	33,75
MOTA ENGIL	2,238	0,09	39,01
NAVIGATOR	4,144	0,48	15,11
NOS	5,990	0,93	13,13
NOVABASE	2,490	0,00	23,27
PHAROL	0,185	0,22	13,36
REN	2,545	0,00	4,56
SEMAPA	14,640	0,69	11,76
SONAE CAP.	0,889	0,79	4,71
SONAE SGPS	0,946	1,34	16,73

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP R	2,83
J MARTINS	2,79
CORT. AMORIM	1,78
GALP	1,63
SONAE SGPS	1,34
EDP	-0,09
BCP	-0,51



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.325,09	0,94%	12,55%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.449,88	0,25%	15,20%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.424,65	0,22%	14,10%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.905,91	0,47%	12,76%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.884,64	0,24%	15,09%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.406,50	-0,01%	10,15%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.687,57	-0,53%	8,36%	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.