

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

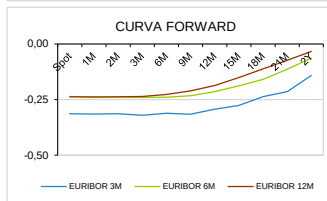
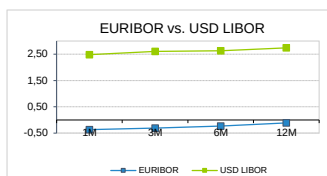
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

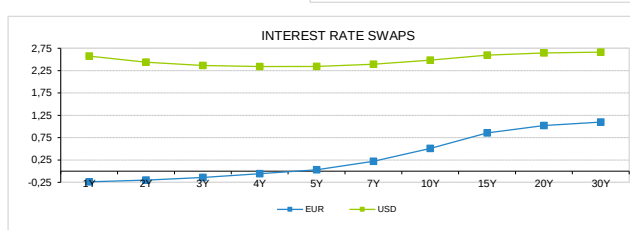
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4820	0	-1	0,7294	-0,7886
3M	-0,3100	0	0	3M	2,6035	2	1	0,8240	-0,7166
6M	-0,2320	0	0	6M	2,6270	0	-5	0,9418	-0,6540
12M	-0,1120	0	0	12M	2,7401	-1	-12	1,0750	-0,5016

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2375	0	-1	-0,1881	0,1645	0,5910
2Y	-0,2020	-1	-2	-0,1097	0,2700	0,7002
3Y	-0,1390	-1	-3	-0,0201	0,3781	0,8069
4Y	-0,0580	-1	-4	0,0774	0,4853	0,9077
5Y	0,0300	-2	-4	0,1786	0,5914	0,9957
7Y	0,2220	-2	-5	0,3865	0,7866	1,1447
10Y	0,5090	-2	-5	0,6681	1,0022	1,2830
15Y	0,8540	-2	-7	0,9617	1,1918	1,3800
20Y	1,0210	-2	-7	1,0994	1,2588	1,3770
30Y	1,0980	-1	-8	1,1459	1,2425	1,3100

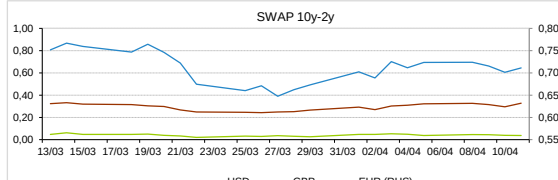
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5750	-1	-9	2,2980	2,2300	2,4430
2Y	2,4390	-1	-15	2,2020	2,3009	2,4945
3Y	2,3650	-1	-17	2,2270	2,3330	2,5400
4Y	2,3410	-1	-17	2,2170	2,3810	2,5780
5Y	2,3440	-1	-17	2,3119	2,4290	2,6378
7Y	2,3920	-1	-17	2,3690	2,4870	2,6994
10Y	2,4840	-1	-18	2,5005	2,6065	2,7285
15Y	2,5960	-1	-18	2,5910	2,6760	2,7550
20Y	2,6440	-1	-18	2,6590	2,7212	2,7530
30Y	2,6630	-1	-17	2,6756	2,6950	2,7270

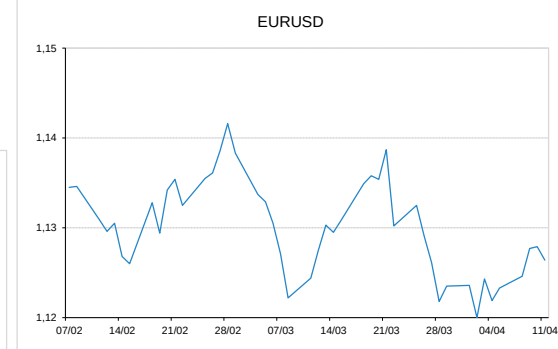
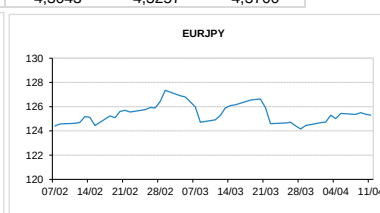


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	71,02	-0,71	4,54	OT 2Y	-0,360	-0,03	-11,60
JETFUEL	666,00	-3,07	17,85	OT 5Y	0,092	-0,03	-13,40
DIESEL	636,25	-2,07	21,70	OT 10Y	1,132	-0,04	-20,40
COBRE	6.462,00	-23,00	69,00	BUND 10Y	-0,412	2,09	-7,60
ZINCO	2.932,50	19,50	210,00	SCHATZ 2Y	0,034	0,92	-3,50
OURO	1.294,55	-15,45	3,45	T-NOTE 10Y	3,217	1,62	-7,90
TRIGO	465,25	3,75	28,25	T-NOTE 2Y	2,702	2,33	-8,00
LICENÇA C02	27,27	1,14	4,99	GILT 10Y	1,075	5,87	-3,20



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1264	-0,13%	0,18%	1,1351	1,1438	1,1610
EUR/GBP	0,86168	-0,10%	0,08%	0,8644	0,8672	0,8732
EUR/JPY	125,3	0,06%	-0,31%	125,30	125,30	125,30
EUR/CHF	1,1295	0,06%	0,62%	1,1285	1,1274	1,1252
EUR/BRL	4,3403	-0,65%	-0,51%	4,4042	4,4721	4,6010
EUR/PLN	4,2832	-0,07%	0,42%	4,3043	4,3257	4,3700



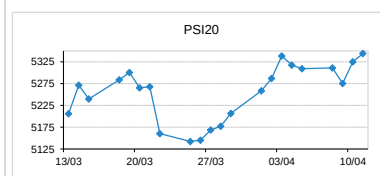
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1264	0,8617	125,30	1,1295	10,4461	7,4648	1,5065	1,57993	4,3403	9,6124
USD	0,8870	-	0,7641	111,475	1,0026	9,2649	6,6212	1,3369	1,4007	3,8336	8,5232

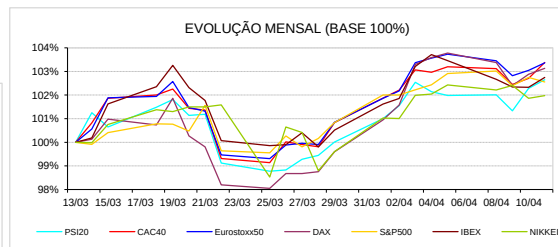
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,195	0,49	24,05
BCP	0,237	0,47	3,40
CORT. AMORIM	10,220	-0,78	13,56
CTT	2,680	1,52	-9,03
EDP	3,418	-1,50	12,10
EDP R	8,790	0,69	13,05
GALP	14,535	-0,51	5,36
IBERSOL	8,040	0,00	1,77
J MARTINS	13,980	1,08	35,20
MOTA ENGIL	2,316	3,49	43,85
NAVIGATOR	4,178	0,82	16,06
NOS	6,100	1,84	15,20
NOVABASE	2,500	0,40	23,76
PHAROL	0,184	-0,54	12,75
REN	2,540	-0,20	4,35
SEMAPA	14,600	-0,27	11,45
SONAE CAP.	0,887	-0,22	4,48
SONAE SGPS	0,955	1,00	17,90

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	3,49
NOS	1,84
CTT	1,52
J MARTINS	1,08
SONAE SGPS	1,00
SEMAPA	-0,27
GALP	-0,51
PHAROL	-0,54
CORT. AMORIM	-0,78
EDP	-1,50



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.344,12	0,36%	12,95%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.485,72	0,66%	15,96%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.435,34	0,31%	14,46%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.935,20	0,25%	13,03%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.883,86	-0,19%	15,00%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.445,40	0,41%	10,60%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.711,38	0,11%	8,48%	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.