

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

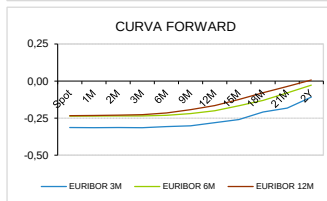
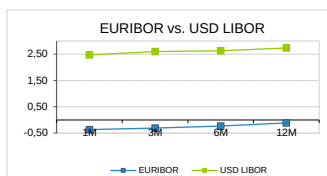
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

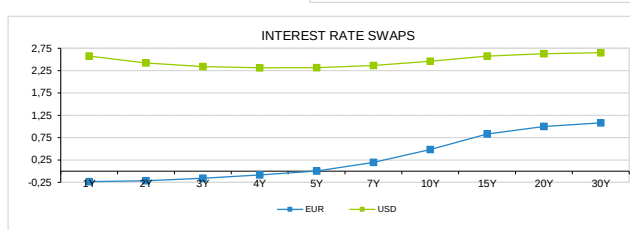
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4726	-1	-3	0,7298	-0,7856
3M	-0,3100	0	0	3M	2,5968	-1	-1	0,8276	-0,7162
6M	-0,2320	0	0	6M	2,6313	0	-5	0,9410	-0,6482
12M	-0,1120	0	0	12M	2,7341	-1	-13	1,0845	-0,5056

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2337	0	-1	-0,1648	0,2265	0,6521
2Y	-0,2150	-1	-4	-0,0787	0,3355	0,7610
3Y	-0,1590	-2	-6	0,0222	0,4410	0,8660
4Y	-0,0830	-3	-7	0,1269	0,5480	0,9650
5Y	0,0040	-3	-8	0,2314	0,6520	1,0610
7Y	0,1950	-3	-8	0,4413	0,8465	1,2010
10Y	0,4840	-3	-7	0,7225	1,0654	1,3450
15Y	0,8300	-2	-7	1,0215	1,2568	1,4400
20Y	1,0010	-2	-7	1,1559	1,3186	1,4380
30Y	1,0810	-2	-7	1,2027	1,3017	1,3700

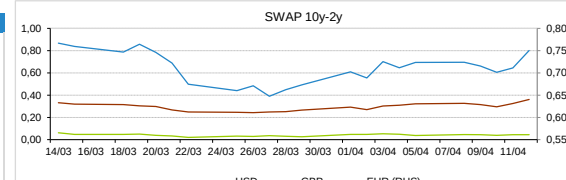
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5730	0	-9	2,3683	2,3034	2,4940
2Y	2,4210	-2	-17	2,2980	2,3390	2,5510
3Y	2,3380	-3	-19	2,2980	2,3860	2,5785
4Y	2,3130	-3	-19	2,3170	2,4410	2,6310
5Y	2,3150	-3	-20	2,3700	2,4835	2,6872
7Y	2,3650	-3	-20	2,4300	2,5595	2,7140
10Y	2,4590	-3	-20	2,5350	2,6550	2,7630
15Y	2,5760	-2	-20	2,6390	2,7210	2,7950
20Y	2,6280	-2	-19	2,6840	2,7400	2,7920
30Y	2,6500	-1	-19	2,6970	2,7330	2,7660

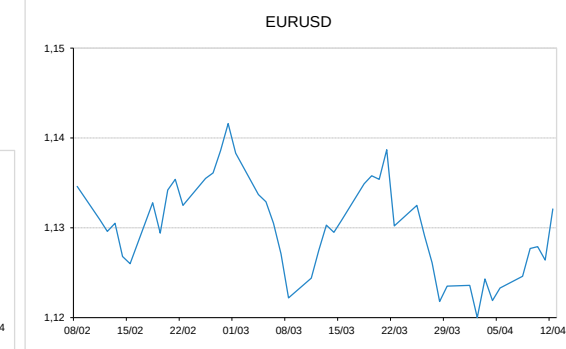
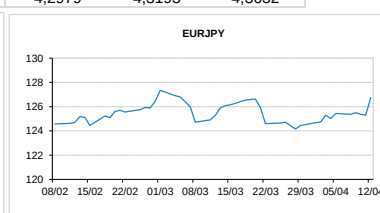


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	71,56	0,73	4,98	OT 2Y	-0,347	0,01	-10,10
JETFUEL	666,94	0,94	22,19	OT 5Y	0,126	0,03	-12,00
DIESEL	637,75	1,50	25,00	OT 10Y	1,173	0,04	-17,10
COBRE	6.404,50	-56,00	1,00	BUND 10Y	-0,344	6,65	-1,40
ZINCO	2.926,00	-6,50	172,50	SCHATZ 2Y	0,055	1,84	-1,20
OURO	1.291,66	-1,26	-6,95	T-NOTE 10Y	3,264	3,89	-3,40
TRIGO	464,50	-1,00	3,75	T-NOTE 2Y	2,747	3,69	-3,30
LICENÇA C02	26,53	-0,79	4,20	GILT 10Y	1,140	6,46	0,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1321	0,51%	0,41%	1,1408	1,1496	1,1670
EUR/GBP	0,8629	-0,14%	-0,17%	0,8656	0,8685	0,8745
EUR/JPY	126,76	-1,15%	-1,18%	126,76	126,76	126,76
EUR/CHF	1,1328	-0,32%	0,39%	1,1318	1,1307	1,1284
EUR/BRL	4,3736	-0,67%	-1,62%	4,4376	4,5055	4,6357
EUR/PLN	4,2768	0,13%	0,51%	4,2979	4,3193	4,3632



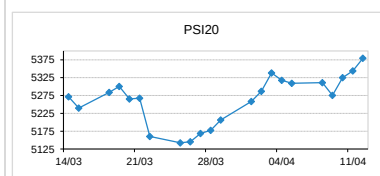
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1321	0,8629	126,76	1,1328	10,4715	7,4643	1,5078	1,5757	4,3736	9,6058
USD	0,8839	-	0,7634	111,965	1,0011	9,2579	6,5975	1,3329	1,3932	3,8675	8,4945

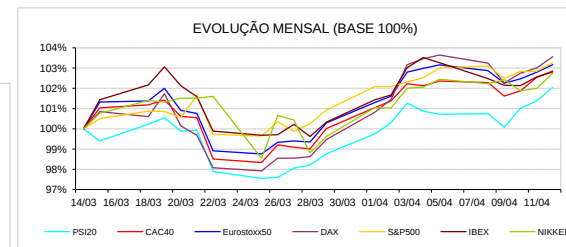
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,270	1,04	25,34
BCP	0,240	1,10	4,53
CORT. AMORIM	10,360	1,37	15,11
CTT	2,702	0,82	-8,28
EDP	3,484	1,93	14,27
EDP R	8,680	-1,25	11,64
GALP	14,655	0,83	6,23
IBERSOL	7,920	-1,49	0,25
J MARTINS	14,050	0,50	35,88
MOTA ENGIL	2,300	-0,69	42,86
NAVIGATOR	4,240	1,48	17,78
NOS	6,105	0,08	15,30
NOVABASE	2,530	1,20	25,25
PHAROL	0,181	-1,63	10,91
REN	2,535	-0,20	4,15
SEMAPA	14,840	1,64	13,28
SONAE CAP.	0,890	0,34	4,83
SONAE SGPS	0,957	0,16	18,09

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP	1,93
SEMAPA	1,64
NAVIGATOR	1,48
CORT. AMORIM	1,37
NOVABASE	1,20
REN	-0,20
MOTA ENGIL	-0,69
EDP R	-1,25
IBERSOL	-1,49
PHAROL	-1,63



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.379,51	0,66%	13,70%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.502,70	0,31%	16,32%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.447,83	0,36%	14,87%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.999,93	0,54%	13,65%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.900,15	0,41%	15,69%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.468,50	0,24%	10,87%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.870,56	0,73%	9,27%	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.