

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

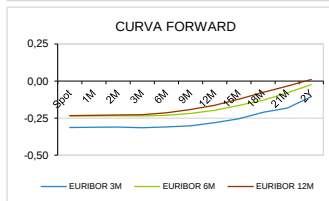
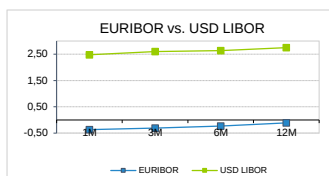
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

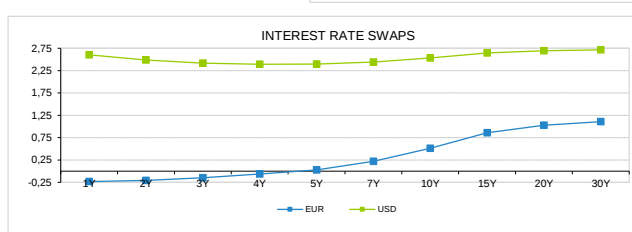
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4774	0	-1	0,7303	-0,7854
3M	-0,3100	0	0	3M	2,6010	0	1	0,8289	-0,7166
6M	-0,2310	0	0	6M	2,6378	1	-4	0,9416	-0,6514
12M	-0,1110	0	0	12M	2,7484	1	-12	1,0936	-0,5114

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,2330	1	-1	-0,1650	0,2299	0,6600	
2Y	-0,2090	1	-4	-0,0766	0,3402	0,7701	
3Y	-0,1470	1	-6	0,0246	0,4474	0,8761	
4Y	-0,0650	2	-7	0,1304	0,5546	0,9725	
5Y	0,0260	2	-7	0,2354	0,6597	1,0620	
7Y	0,2200	3	-8	0,4466	0,8515	1,2090	
10Y	0,5110	3	-8	0,7280	1,0730	1,3570	
15Y	0,8590	3	-9	1,0313	1,2687	1,4545	
20Y	1,0280	3	-9	1,1677	1,3318	1,4530	
30Y	1,1080	3	-10	1,2154	1,3159	1,3855	

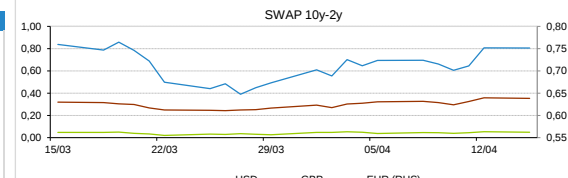
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6040	2	-5	2,3761	2,3241	2,5000
2Y	2,4870	4	-9	2,3105	2,3485	2,5540
3Y	2,4160	5	-10	2,3294	2,3980	2,6000
4Y	2,3920	6	-10	2,3511	2,4490	2,6568
5Y	2,3940	5	-10	2,3615	2,4975	2,6957
7Y	2,4410	5	-11	2,4588	2,5735	2,7260
10Y	2,5310	5	-11	2,5460	2,6655	2,7730
15Y	2,6440	5	-11	2,6718	2,7280	2,8035
20Y	2,6930	4	-11	2,6910	2,7728	2,7960
30Y	2,7140	4	-10	2,7095	2,7425	2,7800

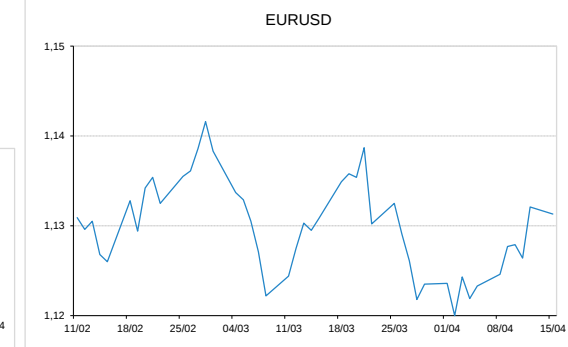
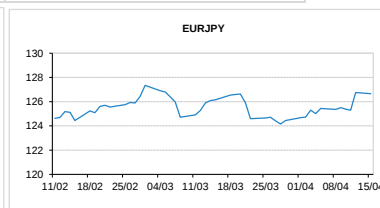
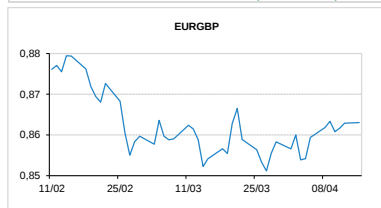


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	71,07	-0,48	4,03	OT 2Y	-0,345	0,00	-10,10
JETFUEL	665,50	-1,44	24,50	OT 5Y	0,159	0,03	-8,50
DIESEL	635,50	-2,25	27,25	OT 10Y	1,196	0,02	-13,60
COBRE	6.505,50	76,00	12,00	BUND 10Y	-0,344	-0,29	-3,80
ZINCO	3.011,00	85,00	154,00	SCHATZ 2Y	0,057	0,00	-1,40
OURO	1.289,43	-2,65	-13,24	T-NOTE 10Y	3,267	-0,65	-4,90
TRIGO	463,00	-5,50	-5,25	T-NOTE 2Y	2,755	0,19	-3,70
LICENÇA C02	26,84	0,26	4,37	GILT 10Y	1,148	0,19	-1,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1313	-0,07%	0,04%	1,1401	1,1488	1,1664
EUR/GBP	0,86305	-0,02%	-1,03%	0,8657	0,8686	0,8747
EUR/JPY	126,66	0,08%	-0,39%	126,66	126,66	126,66
EUR/CHF	1,1349	-0,19%	0,00%	1,1339	1,1328	1,1306
EUR/BRL	4,3756	0,25%	-1,26%	4,4385	4,5069	4,6351
EUR/PLN	4,2729	0,12%	0,62%	4,2942	4,3155	4,3600



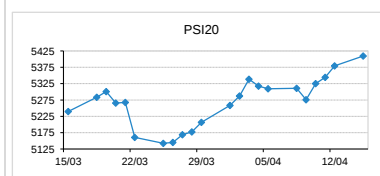
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1313	0,8631	126,66	1,1349	10,4708	7,4647	1,5118	1,57489	4,3756	9,6086
USD	0,8842	-	0,7625	112,005	1,0033	9,2516	6,6001	1,3370	1,3934	3,8844	8,4934

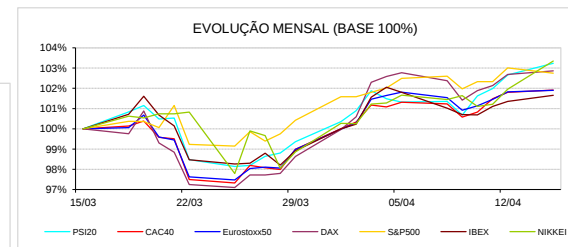
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,365	1,31	26,98
BCP	0,249	3,58	8,28
CORT. AMORIM	10,380	0,19	15,33
CTT	2,718	0,59	-7,74
EDP	3,460	-0,69	13,48
EDP R	8,650	-0,35	11,25
GALP	14,480	-1,19	4,97
IBERSOL	8,020	1,26	1,52
J MARTINS	14,215	1,17	37,48
MOTA ENGIL	2,296	-0,17	42,61
NAVIGATOR	4,292	1,23	19,22
NOS	6,090	-0,25	15,01
NOVABASE	2,490	-1,58	23,27
PHAROL	0,181	-0,11	10,78
REN	2,550	0,59	4,77
SEMAPA	15,040	1,35	14,81
SONAE CAP.	0,888	-0,22	4,59
SONAE SGPS	0,959	0,26	18,40

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	3,58
SEMAPA	1,35
ALTRI	1,31
IBERSOL	1,26
NAVIGATOR	1,23
NOS	-0,25
EDP R	-0,35
EDP	-0,69
GALP	-1,19
NOVABASE	-1,58



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.409,55	0,56%	14,33%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.508,73	0,11%	16,45%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.450,46	0,08%	14,96%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	12.020,28	0,17%	13,84%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.900,03	-0,25%	15,68%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.497,10	0,30%	11,21%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	22.169,11	1,37%	10,76%	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.