

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

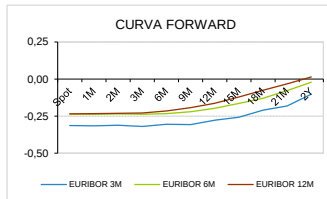
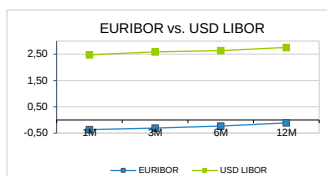
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

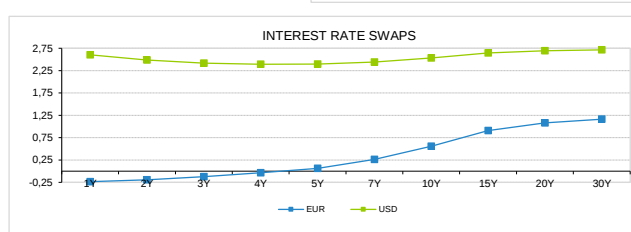
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4739	0	-1	0,7339	-0,7872
3M	-0,3100	0	0	3M	2,5880	-1	-4	0,8209	-0,7182
6M	-0,2320	0	0	6M	2,6376	0	-3	0,9476	-0,6520
12M	-0,1120	0	0	12M	2,7549	1	-9	1,1046	-0,5132

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2346	0	-1	-0,1627	0,2360	0,6640
2Y	-0,1950	1	-2	-0,0755	0,3450	0,7750
3Y	-0,1240	2	-3	0,0296	0,4520	0,8830
4Y	-0,0350	3	-3	0,1350	0,5590	0,9835
5Y	0,0620	4	-3	0,2410	0,6670	1,0745
7Y	0,2630	4	-3	0,4540	0,8620	1,2215
10Y	0,5560	5	-3	0,7380	1,0852	1,3685
15Y	0,9090	5	-3	1,0425	1,2814	1,4665
20Y	1,0810	5	-3	1,1797	1,3449	1,4650
30Y	1,1630	6	-4	1,2277	1,3280	1,3970

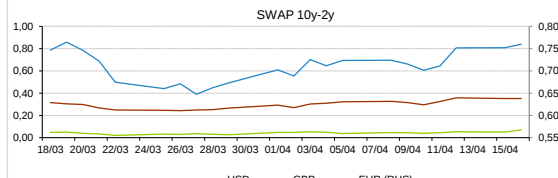
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6040	2	-5	2,3945	2,3675	2,5420
2Y	2,4870	4	-9	2,3380	2,4184	2,5930
3Y	2,4160	5	-10	2,3440	2,4712	2,6410
4Y	2,3920	6	-10	2,3670	2,4930	2,6770
5Y	2,3940	5	-10	2,3990	2,5380	2,7362
7Y	2,4410	5	-11	2,4967	2,6180	2,7700
10Y	2,5310	5	-11	2,6046	2,7030	2,8160
15Y	2,6440	5	-11	2,7068	2,7680	2,8440
20Y	2,6930	4	-11	2,7290	2,7860	2,8370
30Y	2,7140	4	-10	2,7400	2,7780	2,8085

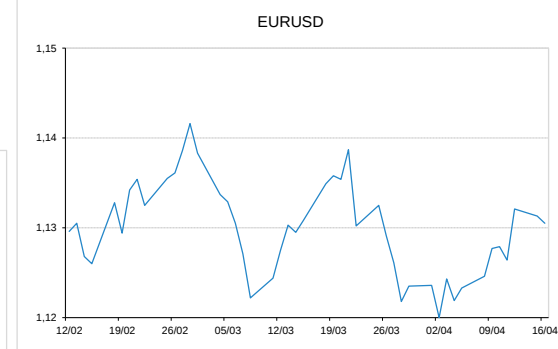
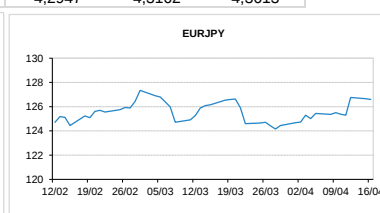


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	71,22	0,04	4,18	OT 2Y	-0,347	0,00	-9,90
JETFUEL	665,50	-1,44	24,50	OT 5Y	0,149	-0,01	-7,80
DIESEL	635,50	-2,25	27,25	OT 10Y	1,197	0,00	-11,30
COBRE	6.490,00	-4,00	49,00	BUND 10Y	-0,341	0,36	-3,50
ZINCO	2.937,00	-34,00	137,00	SCHATZ 2Y	0,048	-0,69	-3,00
OURO	1.275,05	-14,44	-27,62	T-NOTE 10Y	3,296	2,93	1,00
TRIGO	449,75	-13,50	-18,50	T-NOTE 2Y	2,766	1,36	-0,60
LICENÇA C02	26,89	0,08	4,42	GILT 10Y	1,149	-0,09	0,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1305	-0,07%	-0,39%	1,1392	1,1480	1,1657
EUR/GBP	0,8639	-0,10%	-0,85%	0,8666	0,8694	0,8756
EUR/JPY	126,59	0,06%	-0,04%	126,59	126,59	126,59
EUR/CHF	1,1365	-0,12%	-0,18%	1,1354	1,1344	1,1322
EUR/BRL	4,4075	-0,72%	-2,46%	4,4697	4,5371	4,6658
EUR/PLN	4,2733	0,00%	0,38%	4,2947	4,3162	4,3613



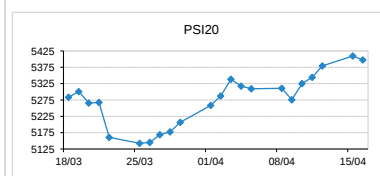
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1305	0,8639	126,59	1,1365	10,4437	7,4649	1,5080	1,57429	4,4075	9,5823
USD	0,8850	-	0,766	111,945	1,0066	9,2517	6,6034	1,3359	1,3940	3,8874	8,4787

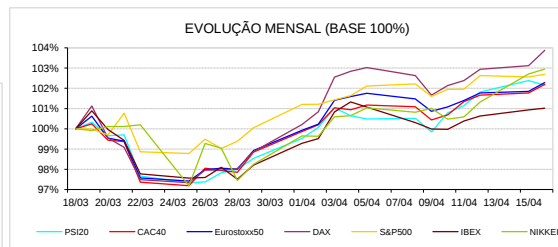
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,350	-0,20	26,72
BCP	0,250	0,60	8,93
CORT. AMORIM	10,540	1,54	17,11
CTT	2,736	0,66	-7,13
EDP	3,420	-1,16	12,17
EDP R	8,620	-0,35	10,87
GALP	14,410	-0,48	4,46
IBERSOL	8,160	1,75	3,29
J MARTINS	14,020	-1,37	35,59
MOTA ENGIL	2,284	-0,52	41,86
NAVIGATOR	4,320	0,65	20,00
NOS	6,070	-0,33	14,64
NOVABASE	2,490	0,00	23,27
PHAROL	0,179	-1,11	9,56
REN	2,545	-0,20	4,56
SEMAPA	15,200	1,06	16,03
SONAE CAP.	0,891	0,34	4,95
SONAE SGPS	0,964	0,47	18,95

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	1,75
CORT. AMORIM	1,54
SEMAPA	1,06
CTT	0,66
NAVIGATOR	0,65
GALP	-0,48
MOTA ENGIL	-0,52
PHAROL	-1,11
EDP	-1,16
J MARTINS	-1,37



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.397,71	-0,22%	14,08%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.531,65	0,42%	16,93%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.465,39	0,43%	15,46%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	12.108,87	0,74%	14,68%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.909,25	0,13%	16,05%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.505,00	0,08%	11,30%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	22.221,66	0,24%	11,03%	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.