

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

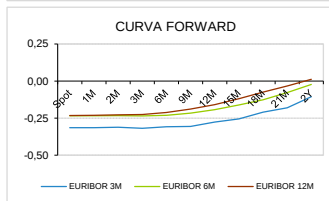
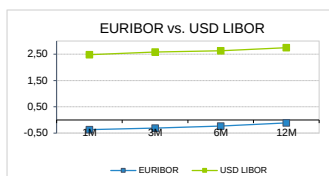
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

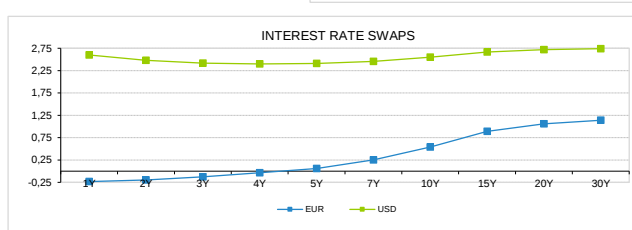
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4809	-1	-1	0,7326	-0,7872
3M	-0,3110	0	0	3M	2,5811	-1	-5	0,8220	-0,7172
6M	-0,2300	0	0	6M	2,6290	0	-4	0,9413	-0,6546
12M	-0,1120	0	0	12M	2,7464	-2	-7	1,0998	-0,5132

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2330	0	-1	-0,1596	0,2167	0,6390
2Y	-0,1980	-1	-2	-0,0735	0,3259	0,7460
3Y	-0,1280	-1	-3	0,0235	0,4300	0,8550
4Y	-0,0370	-2	-3	0,1269	0,5360	0,9520
5Y	0,0580	-2	-3	0,2280	0,6420	1,0430
7Y	0,2530	-3	-3	0,4360	0,8320	1,1850
10Y	0,5410	-4	-4	0,7140	1,0501	1,3320
15Y	0,8890	-5	-4	1,0098	1,2407	1,4290
20Y	1,0600	-5	-5	1,1476	1,3080	1,4270
30Y	1,1390	-5	-5	1,1937	1,2910	1,3580

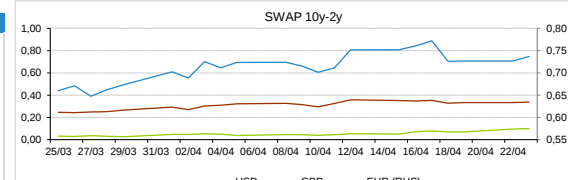
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5990	-1	-6	2,3267	2,3379	2,5350
2Y	2,4790	-3	-9	2,2975	2,3937	2,6078
3Y	2,4170	-3	-9	2,3107	2,4205	2,6340
4Y	2,3990	-3	-8	2,3432	2,4790	2,6929
5Y	2,4090	-3	-7	2,3873	2,5270	2,7328
7Y	2,4570	-3	-7	2,4520	2,6080	2,7660
10Y	2,5510	-4	-7	2,5842	2,6960	2,8120
15Y	2,6670	-3	-7	2,6700	2,7600	2,8650
20Y	2,7170	-3	-6	2,7375	2,8032	2,8290
30Y	2,7400	-3	-6	2,7290	2,7720	2,8030

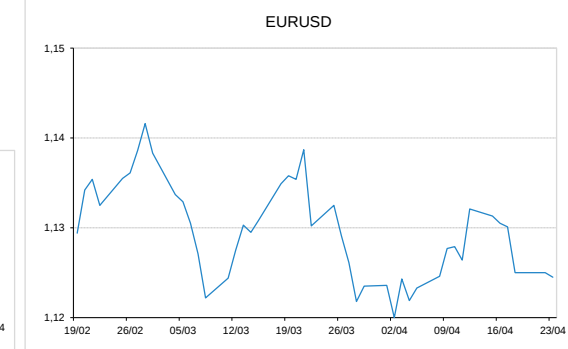
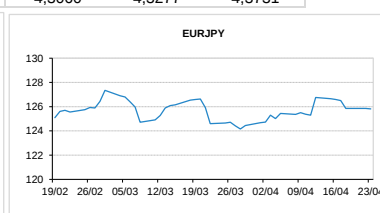
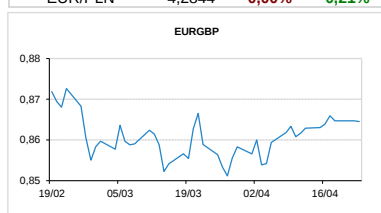


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	74,42	0,38	7,67	OT 2Y	-0,336	0,02	-6,80
JETFUEL	668,50	-1,25	27,75	OT 5Y	0,154	0,02	-4,70
DIESEL	638,75	-1,50	30,50	OT 10Y	1,204	0,03	-5,90
COBRE	6.464,50	-80,00	51,00	BUND 10Y	-0,364	2,10	5,80
ZINCO	2.816,00	-47,00	21,50	SCHATZ 2Y	0,046	0,46	0,00
OURO	1.271,30	-3,09	-41,61	T-NOTE 10Y	3,270	-1,95	9,40
TRIGO	442,50	0,75	-28,25	T-NOTE 2Y	2,729	-1,94	7,90
LICENÇA C02	27,57	0,68	6,90	GILT 10Y	1,154	3,05	22,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1245	-0,04%	-0,71%	1,1332	1,1418	1,1591
EUR/GBP	0,8645	0,02%	-0,94%	0,8672	0,8701	0,8764
EUR/JPY	125,82	0,03%	-0,93%	125,82	125,82	125,82
EUR/CHF	1,1457	-0,20%	-2,01%	1,1446	1,1435	1,1413
EUR/BRL	4,4214	0,21%	-1,35%	4,4864	4,5541	4,6818
EUR/PLN	4,2844	0,00%	0,21%	4,3060	4,3277	4,3731



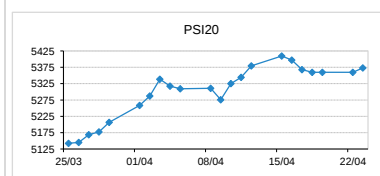
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1245	0,8645	125,82	1,1457	10,5057	7,4664	1,5047	1,58031	4,4214	9,5893
USD	0,8923	-	0,7729	111,895	1,0214	9,3718	6,6622	1,3410	1,4101	3,9549	8,5588

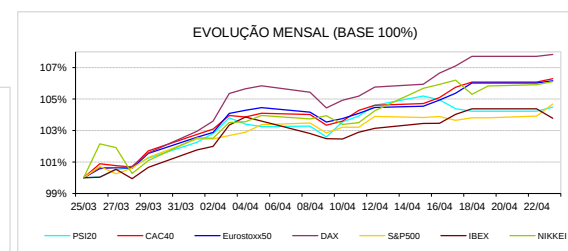
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,305	0,27	25,95
BCP	0,249	-0,24	8,32
CORT. AMORIM	10,700	1,52	18,89
CTT	2,704	-1,60	-8,21
EDP	3,422	-0,64	12,23
EDP R	8,700	-0,57	11,90
GALP	14,965	3,85	8,48
IBERSOL	7,900	-1,25	0,00
J MARTINS	13,840	-1,35	33,85
MOTA ENGIL	2,372	2,95	47,33
NAVIGATOR	3,992	0,10	10,89
NOS	5,970	-0,67	12,75
NOVABASE	2,500	-0,79	23,76
PHAROL	0,169	0,00	3,80
REN	2,510	-0,20	3,12
SEMAPA	15,120	0,40	15,42
SONAE CAP.	0,915	1,10	7,77
SONAE SGPS	0,980	2,46	20,99

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
GALP	3,85
MOTA ENGIL	2,95
SONAE SGPS	2,46
CORT. AMORIM	1,52
SONAE CAP.	1,10
NOS	-0,67
NOVABASE	-0,79
IBERSOL	-1,25
J MARTINS	-1,35
CTT	-1,60



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.373,17	0,25%	13,56%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.591,69	0,20%	18,20%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.503,85	0,13%	16,74%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	12.235,51	0,11%	15,88%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.929,54	0,74%	16,86%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.527,20	-0,57%	11,56%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	22.259,74	0,19%	11,22%	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.