

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

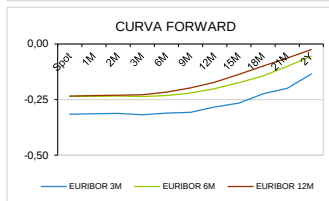
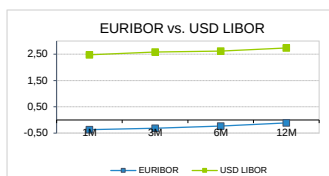
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

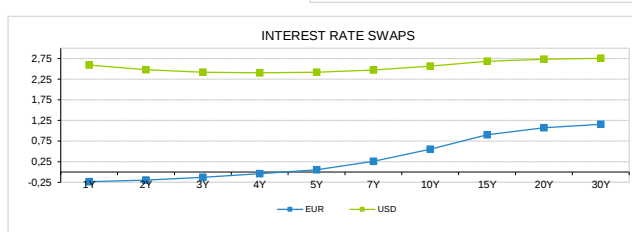
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4766	0	-2	0,7330	-0,7914
3M	-0,3120	0	0	3M	2,5803	0	-3	0,8228	-0,7168
6M	-0,2310	0	0	6M	2,6199	-1	-6	0,9448	-0,6530
12M	-0,1120	0	0	12M	2,7356	-1	-5	1,0930	-0,5120

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2342	0	-1	-0,1734	0,1577	0,5767
2Y	-0,1970	0	-2	-0,0983	0,2583	0,6831
3Y	-0,1280	0	-2	-0,0125	0,3643	0,7898
4Y	-0,0390	0	-1	0,0805	0,4690	0,8879
5Y	0,0560	0	0	0,1787	0,5740	0,9695
7Y	0,2580	1	2	0,3810	0,7663	1,1220
10Y	0,5510	1	4	0,6550	0,9812	1,2688
15Y	0,9020	1	6	0,9481	1,1738	1,3694
20Y	1,0740	1	7	1,0874	1,2435	1,3650
30Y	1,1560	2	6	1,1345	1,2285	1,3010

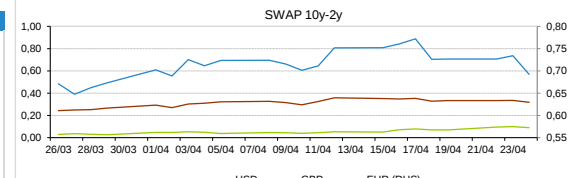
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5940	-1	2	2,2791	2,2600	2,4710
2Y	2,4790	0	6	2,2125	2,3080	2,5270
3Y	2,4200	0	9	2,2275	2,3650	2,5790
4Y	2,4050	1	11	2,2670	2,4180	2,6220
5Y	2,4180	1	13	2,3070	2,4670	2,6810
7Y	2,4710	1	14	2,4167	2,5540	2,7155
10Y	2,5670	2	15	2,5321	2,6460	2,7630
15Y	2,6830	2	14	2,6190	2,7120	2,7960
20Y	2,7340	2	14	2,6675	2,7330	2,7860
30Y	2,7560	2	14	2,6840	2,7295	2,7610

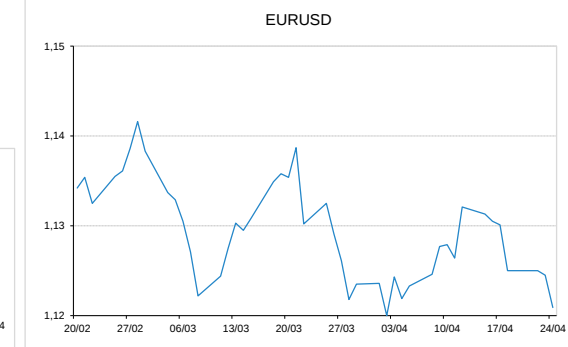
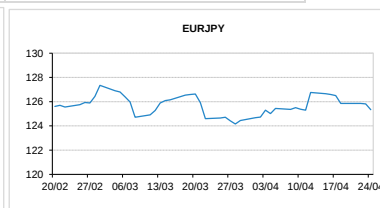
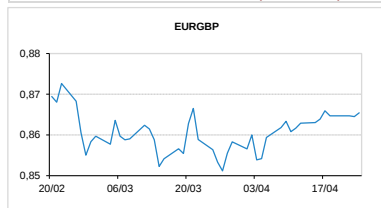


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	74,41	-0,10	7,66	OT 2Y	-0,341	0,00	-7,00
JETFUEL	680,12	-0,63	43,12	OT 5Y	0,132	-0,02	-8,70
DIESEL	650,00	-0,25	48,25	OT 10Y	1,170	-0,03	-12,50
COBRE	6.414,00	-69,00	95,00	BUND 10Y	-0,420	-5,56	-0,30
ZINCO	2.797,00	-19,00	-38,00	SCHATZ 2Y	0,032	-1,38	-2,10
OURO	1.277,45	4,68	-35,46	T-NOTE 10Y	3,230	-4,06	8,40
TRIGO	438,75	-6,25	-32,00	T-NOTE 2Y	2,687	-3,69	10,70
LICENÇA C02	27,43	-0,10	6,76	GILT 10Y	1,100	-5,08	19,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1209	-0,32%	-1,02%	1,1296	1,1382	1,1551
EUR/GBP	0,86545	-0,11%	-1,05%	0,8681	0,8711	0,8772
EUR/JPY	125,34	0,38%	-0,55%	125,34	125,34	125,34
EUR/CHF	1,1397	0,46%	-1,50%	1,1387	1,1376	1,1353
EUR/BRL	4,4523	-1,14%	-2,05%	4,5182	4,5857	4,7131
EUR/PLN	4,2955	-0,27%	-0,06%	4,3170	4,3393	4,3833



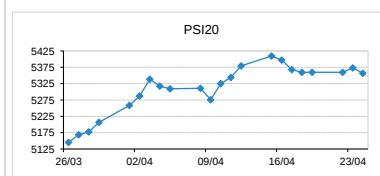
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1209	0,8655	125,34	1,1397	10,5217	7,4667	1,5068	1,59321	4,4523	9,6316
USD	0,8927	-	0,7719	111,755	1,0174	9,3922	6,6654	1,3487	1,4212	3,9671	8,5960

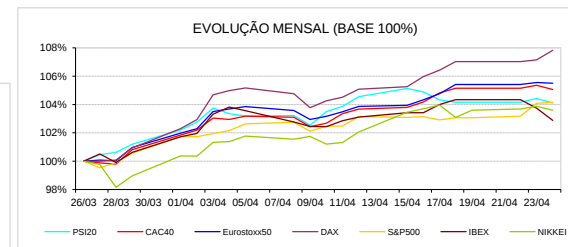
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,130	-2,40	22,93
BCP	0,247	-0,56	7,71
CORT. AMORIM	10,700	0,00	18,89
CTT	2,696	-0,30	-8,49
EDP	3,401	-0,61	11,54
EDP R	8,700	0,00	11,90
GALP	15,030	0,43	8,95
IBERSOL	7,960	0,76	0,76
J MARTINS	13,910	0,51	34,53
MOTA ENIGL	2,334	-1,60	44,97
NAVIGATOR	3,910	-2,05	8,61
NOS	5,975	0,08	12,84
NOVABASE	2,500	0,00	23,76
PHAROL	0,166	-2,24	1,47
REN	2,510	0,00	3,12
SEMAPA	15,160	0,26	15,73
SONAE CAP.	0,923	0,87	8,72
SONAE SGPS	0,974	-0,61	20,25

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE CAP.	0,87
IBERSOL	0,76
J MARTINS	0,51
GALP	0,43
SEMAPA	0,26
EDP	-0,61
MOTA ENIGL	-1,60
NAVIGATOR	-2,05
PHAROL	-2,24
ALTRI	-2,40



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.356,77	-0,31%	13,22%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.576,06	-0,28%	17,87%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.502,04	-0,05%	16,68%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	12.313,16	0,63%	16,61%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.935,62	0,07%	17,11%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.447,90	-0,83%	10,63%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	22.200,00	-0,27%	10,92%	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.