

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

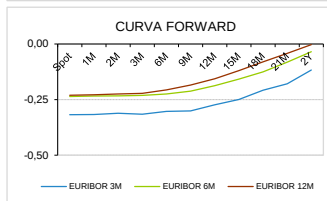
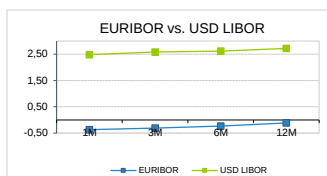
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

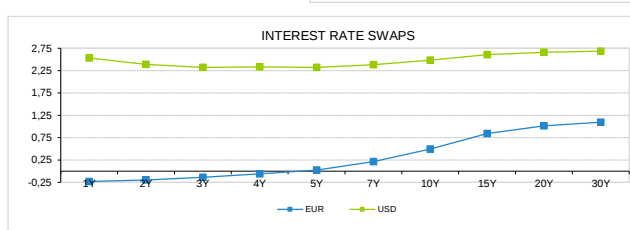
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4831	0	-1	0,7318	-0,7916
3M	-0,3110	0	0	3M	2,5828	0	-1	0,8250	-0,7120
6M	-0,2310	0	0	6M	2,6158	0	-7	0,9369	-0,6422
12M	-0,1140	0	0	12M	2,7175	0	-1	1,0870	-0,5142

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2310	0	0	-0,1576	0,1745	0,5948
2Y	-0,1970	0	-2	-0,0793	0,2733	0,7015
3Y	-0,1370	0	-2	0,0056	0,3799	0,8065
4Y	-0,0600	0	-3	0,0978	0,4864	0,9020
5Y	0,0250	0	-3	0,1965	0,5912	0,9865
7Y	0,2120	0	-1	0,3984	0,7806	1,1340
10Y	0,4950	0	1	0,6720	0,9986	1,2830
15Y	0,8420	0	4	0,9662	1,1913	1,3820
20Y	1,0150	0	5	1,1044	1,2596	1,3810
30Y	1,0950	0	6	1,1483	1,2416	1,3117

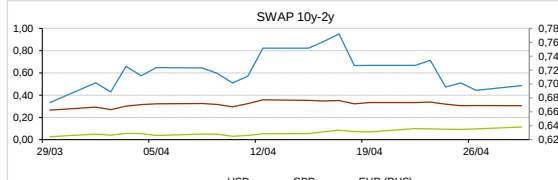
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5310	-2	-1	2,2573	2,2730	2,5010
2Y	2,3870	-3	2	2,2339	2,3570	2,5520
3Y	2,3210	-3	5	2,2540	2,3820	2,6206
4Y	2,3340	-4	4	2,2927	2,4225	2,6637
5Y	2,3210	-3	7	2,3010	2,4815	2,7039
7Y	2,3800	-3	8	2,4070	2,5660	2,7314
10Y	2,4840	-3	8	2,5240	2,6510	2,8105
15Y	2,6060	-3	8	2,6575	2,7190	2,8391
20Y	2,6600	-3	8	2,6690	2,7766	2,8335
30Y	2,6850	-3	8	2,7238	2,7705	2,8060

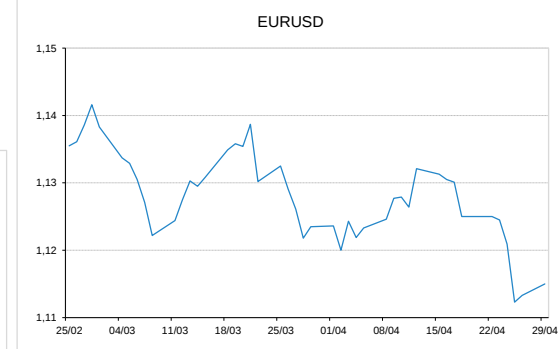
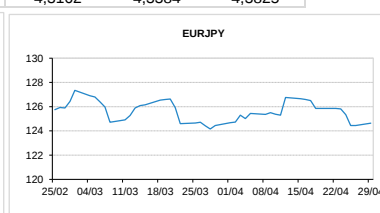


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	72,04	-0,11	4,46	OT 2Y	-0,342	0,01	-3,70
JETFUEL	663,50	4,58	22,10	OT 5Y	0,093	-0,01	-8,80
DIESEL	634,75	6,58	24,75	OT 10Y	1,123	-0,01	-14,90
COBRE	6 401,00	35,00	70,00	BUND 10Y	-0,406	2,23	6,40
ZINCO	2 839,50	31,50	-59,50	SCHATZ 2Y	0,037	1,38	1,90
OURO	1 279,04	-7,21	-13,26	T-NOTE 10Y	3,233	1,94	10,50
TRIGO	436,75	-5,75	-26,75	T-NOTE 2Y	2,661	0,39	9,70
LICENÇA C02	26,41	0,56	4,87	GILT 10Y	1,078	1,10	15,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,115	0,15%	-0,76%	1,1238	1,1325	1,1492
EUR/GBP	0,8634	0,00%	-0,59%	0,8661	0,8690	0,8752
EUR/JPY	124,64	-0,15%	-0,15%	124,64	124,64	124,64
EUR/CHF	1,1391	-0,19%	-1,99%	1,1380	1,1368	1,1347
EUR/BRL	4,3959	-0,26%	0,12%	4,4649	4,5345	4,6685
EUR/PLN	4,2943	0,06%	0,24%	4,3162	4,3384	4,3825



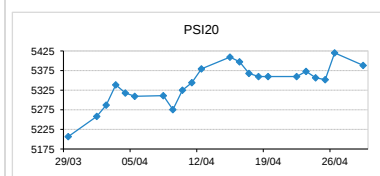
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1150	0,8634	124,64	1,1391	10,6350	7,4655	1,5023	1,58306	4,3959	9,6931
USD	0,8956	-	0,7738	111,805	1,0197	9,5173	6,6869	1,3461	1,4179	3,9341	8,6764

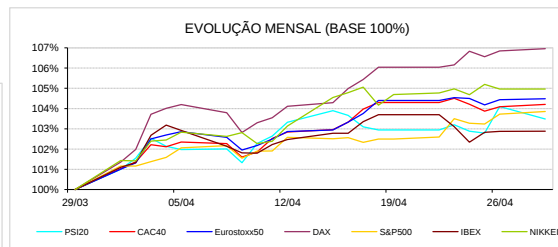
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,070	-1,67	21,90
BCP	0,250	0,48	8,76
CORT. AMORIM	10,640	0,95	18,22
CTT	2,684	-1,03	-8,89
EDP	3,361	-0,71	10,23
EDP R	8,870	-0,11	14,08
GALP	14,990	0,03	8,66
IBERSOL	7,980	1,01	1,01
J MARTINS	14,500	-1,99	40,23
MOTA ENGIL	2,376	-1,41	47,58
NAVIGATOR	3,968	0,05	10,22
NOS	5,975	-0,91	12,84
NOVABASE	2,520	0,80	24,75
PHAROL	0,159	-1,24	-2,57
REN	2,530	-0,20	3,94
SEMAPA	14,640	-1,48	11,76
SONAE CAP.	0,914	-0,11	7,66
SONAE SGPS	0,993	0,61	22,53

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	1,01
CORT. AMORIM	0,95
NOVABASE	0,80
SONAE SGPS	0,61
BCP	0,48
PHAROL	-1,24
MOTA ENGIL	-1,41
SEMAPA	-1,48
ALTRI	-1,67
J MARTINS	-1,99



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5 388,05	-0,59%	13,88%	5 801,45	4 551,84
CAC40	5 575,60	0,11%	17,86%	5 657,44	4 555,99
ESTX 50 PR	3 501,94	0,04%	16,68%	3 596,20	2 908,70
XTRA DAX	12 328,02	0,10%	16,75%	13 204,31	10 279,20
S&P 500	2 943,51	0,13%	17,43%	2 946,23	2 346,58
IBEX 35	9 506,40	0,00%	11,32%	10 291,40	8 286,20
NIKKEI 225	22 258,73	-0,22%	11,21%	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.