

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

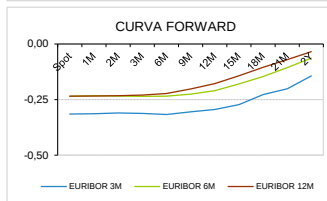
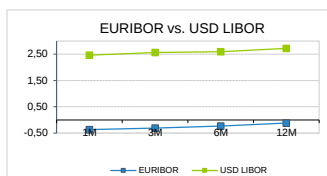
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

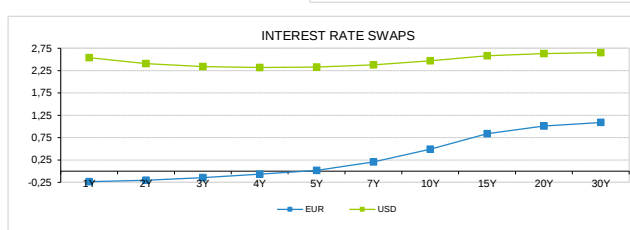
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3660	0	0	1M	2,4628	0	-1	0,7311	-0,7912
3M	-0,3080	0	0	3M	2,5620	0	-3	0,8090	-0,7136
6M	-0,2300	0	0	6M	2,5944	-2	-5	0,9213	-0,6522
12M	-0,1170	0	-1	12M	2,7214	-2	-3	1,0856	-0,5132

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2346	0	0	-0,1796	0,1421	0,5543
2Y	-0,2040	0	-1	-0,1064	0,2421	0,6590
3Y	-0,1450	-1	-2	-0,0233	0,3460	0,7628
4Y	-0,0680	-1	-3	0,0685	0,4488	0,8590
5Y	0,0180	-1	-3	0,1648	0,5521	0,9465
7Y	0,2070	-1	-4	0,3631	0,7424	1,0930
10Y	0,4900	-2	-4	0,6360	0,9576	1,2400
15Y	0,8370	-1	-4	0,9272	1,1503	1,3400
20Y	1,0100	-1	-3	1,0655	1,2191	1,3397
30Y	1,0890	-1	-3	1,1106	1,2025	1,2705

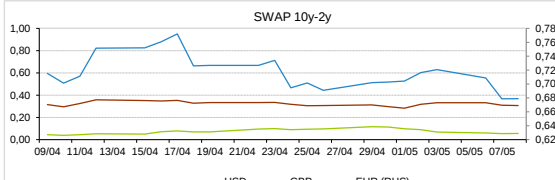
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5390	-2	-4	2,2343	2,2317	2,4100
2Y	2,4060	-3	-4	2,2072	2,2650	2,4415
3Y	2,3400	-3	-3	2,2151	2,3325	2,4710
4Y	2,3190	-4	-3	2,2447	2,3530	2,5330
5Y	2,3290	-4	-2	2,2805	2,3970	2,5944
7Y	2,3770	-4	-2	2,3574	2,5004	2,6230
10Y	2,4690	-4	-1	2,4425	2,5600	2,6555
15Y	2,5810	-4	-1	2,5627	2,6040	2,6785
20Y	2,6310	-4	-1	2,6058	2,6671	2,6950
30Y	2,6520	-4	-1	2,5990	2,6360	2,6475

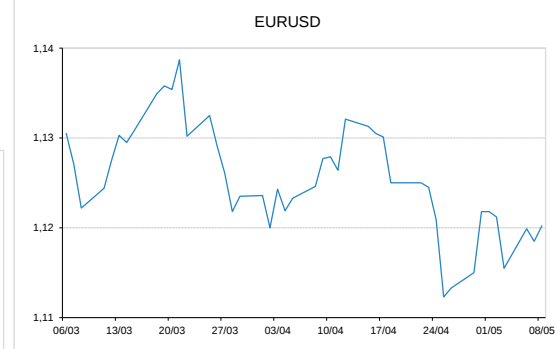
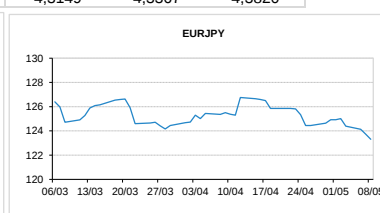


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	70,38	0,50	-0,23	OT 2Y	-0,332	-0,02	-1,20
JETFUEL	669,75	4,49	6,08	OT 5Y	0,062	-0,01	-9,30
DIESEL	640,25	3,74	9,08	OT 10Y	1,085	-0,01	-14,00
COBRE	6.161,50	-56,00	-221,00	BUND 10Y	-0,457	-1,08	-6,20
ZINCO	2.779,00	-74,00	-174,00	SCHATZ 2Y	0,005	-1,38	-3,20
OURO	1.281,14	-3,13	-16,75	T-NOTE 10Y	3,186	0,81	-5,00
TRIGO	437,50	-2,00	-31,25	T-NOTE 2Y	2,654	-0,58	-5,40
LICENÇA C02	26,81	0,41	2,50	GILT 10Y	1,059	-2,76	2,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1202	0,15%	-0,39%	1,1290	1,1375	1,1542
EUR/GBP	0,86095	-0,52%	0,10%	0,8637	0,8665	0,8725
EUR/JPY	123,31	0,34%	1,66%	123,31	123,31	123,31
EUR/CHF	1,1410	0,02%	-1,36%	1,1399	1,1388	1,1366
EUR/BRL	4,4049	0,86%	-1,53%	4,4740	4,5435	4,6730
EUR/PLN	4,2927	-0,03%	-0,10%	4,3149	4,3367	4,3820



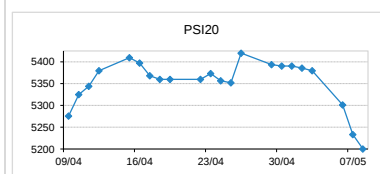
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1202	0,8610	123,31	1,1410	10,7471	7,4658	1,5084	1,59991	4,4049	9,8143
USD	0,8930	-	0,7693	110,135	1,0181	9,5950	6,6664	1,3467	1,4277	3,9323	8,7645

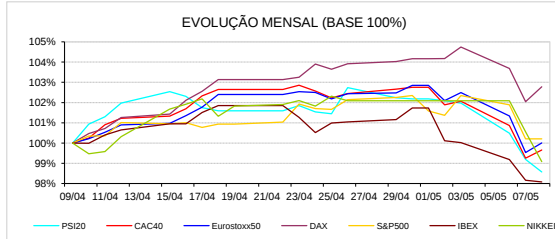
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,535	-1,66	12,67
BCP	0,248	-0,16	8,19
CORT. AMORIM	10,300	-0,19	14,44
CTT	2,410	-2,67	-18,19
EDP	3,282	-0,55	7,64
EDP R	8,570	0,47	10,23
GALP	14,140	-0,35	2,50
IBERSOL	7,940	0,76	0,51
J MARTINS	13,890	-0,86	34,33
MOTA ENGIL	2,202	1,66	36,77
NAVIGATOR	3,642	-1,78	1,17
NOS	5,855	-0,09	10,58
NOVABASE	2,510	-0,79	24,26
PHAROL	0,158	-0,75	-3,19
RAMADA	7,700	-0,26	2,67
REN	13,740	-2,41	4,89
SEMAPA	0,880	-1,12	3,65
SONAE CAP.	0,958	-0,98	18,21
SONAE SGPS	7,700	-0,26	2,67

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	1,66
IBERSOL	0,76
EDP R	0,47
SEMAPA	-1,12
ALTRI	-1,66
NAVIGATOR	-1,78
REN	-2,41
CTT	-2,67



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.200,23	-0,63%	9,91%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.417,59	0,40%	14,52%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.417,26	0,47%	13,85%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	12.179,93	0,72%	15,35%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.884,19	0,00%	15,05%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.227,00	-0,09%	8,05%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.602,59	-1,46%	7,93%	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.