

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

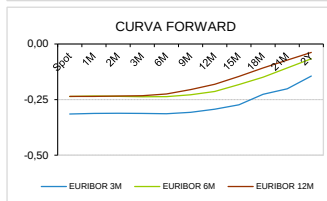
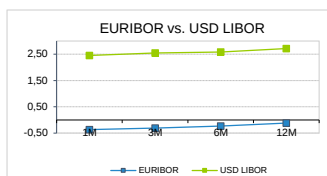
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

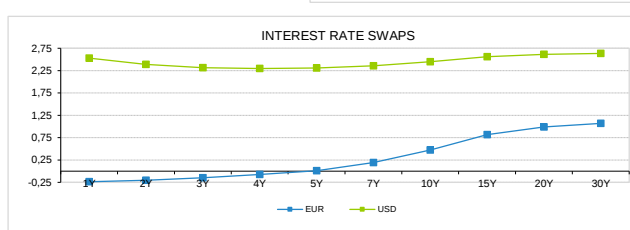
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3660	0	0	1M	2,4514	-1	-3	0,7320	-0,7868
3M	-0,3080	0	0	3M	2,5451	-2	-4	0,8104	-0,7120
6M	-0,2310	0	0	6M	2,5823	-1	-5	0,9178	-0,6546
12M	-0,1180	0	-1	12M	2,7138	-1	-4	1,0718	-0,5130

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2362	0	0	-0,1833	0,1493	0,5598
2Y	-0,2050	0	-1	-0,1096	0,2503	0,6667
3Y	-0,1480	0	-2	-0,0240	0,3530	0,7721
4Y	-0,0740	-1	-3	0,0701	0,4573	0,8699
5Y	0,0100	-1	-3	0,1673	0,5614	0,9564
7Y	0,1940	-1	-4	0,3680	0,7509	1,1013
10Y	0,4740	-2	-5	0,6390	0,9637	1,2496
15Y	0,8180	-2	-4	0,9316	1,1558	1,3492
20Y	0,9900	-2	-4	1,0697	1,2245	1,3488
30Y	1,0690	-2	-4	1,1149	1,2077	1,2798

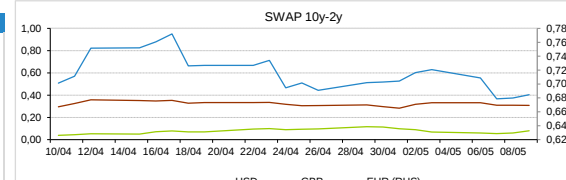
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5290	-1	-5	2,2148	2,1950	2,4000
2Y	2,3870	-2	-6	2,1300	2,2430	2,4510
3Y	2,3160	-2	-6	2,1445	2,3150	2,4755
4Y	2,2960	-2	-6	2,1725	2,3210	2,5350
5Y	2,3070	-2	-4	2,2320	2,3680	2,5957
7Y	2,3560	-2	-4	2,2970	2,4700	2,6100
10Y	2,4490	-2	-3	2,4300	2,5395	2,6760
15Y	2,5620	-2	-3	2,5175	2,6055	2,6825
20Y	2,6130	-2	-3	2,6001	2,6240	2,6770
30Y	2,6340	-2	-3	2,5780	2,6190	2,6915

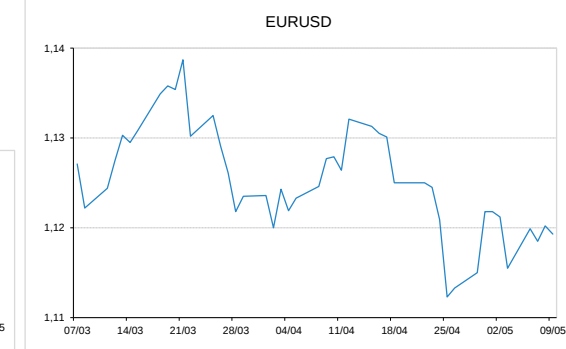
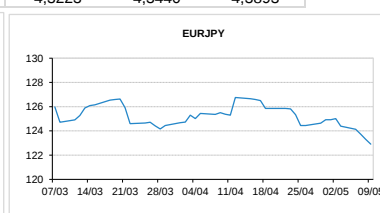


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	69,93	-0,44	-0,23	OT 2Y	-0,333	0,00	-0,20
JETFUEL	666,90	-2,85	5,80	OT 5Y	0,093	0,03	-5,10
DIESEL	635,40	-4,85	5,80	OT 10Y	1,118	0,03	-7,90
COBRE	6.133,00	-32,00	-327,00	BUND 10Y	-0,458	-0,22	-5,30
ZINCO	2.733,50	-45,50	-201,00	SCHATZ 2Y	-0,005	-1,15	-4,90
OURO	1.284,99	4,76	-19,36	T-NOTE 10Y	3,170	-3,55	-4,70
TRIGO	429,75	-9,25	-34,25	T-NOTE 2Y	2,625	-4,65	-6,90
LICENÇA C02	26,65	-0,26	1,12	GILT 10Y	1,042	-1,38	0,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1193	-0,08%	-0,74%	1,1279	1,1364	1,1530
EUR/GBP	0,8612	-0,03%	0,25%	0,8639	0,8667	0,8727
EUR/JPY	122,91	0,33%	2,12%	122,91	122,91	122,91
EUR/CHF	1,1376	0,30%	-0,92%	1,1365	1,1354	1,1332
EUR/BRL	4,4564	-1,33%	-2,61%	4,5258	4,5961	4,7252
EUR/PLN	4,3005	-0,17%	-0,33%	4,3223	4,3440	4,3893



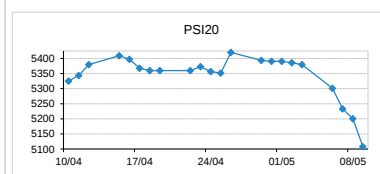
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1193	0,8612	122,91	1,1376	10,8318	7,4665	1,5147	1,60915	4,4564	9,8577
USD	0,8906	-	0,7681	109,565	1,0137	9,6459	6,6493	1,3487	1,4336	3,9678	8,7750

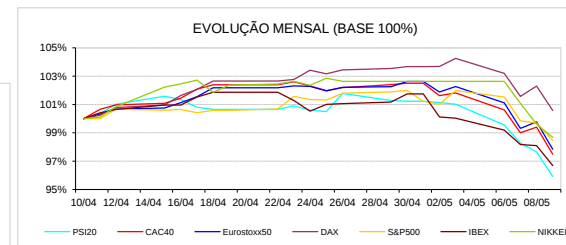
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,515	-0,31	12,33
BCP	0,240	-3,30	4,62
CORT. AMORIM	10,400	0,97	15,56
CTT	2,324	-3,57	-21,11
EDP	3,224	-1,77	5,74
EDP R	8,440	-1,52	8,55
GALP	13,850	-2,05	0,40
IBERSOL	7,920	-0,25	0,25
J MARTINS	13,750	-1,01	32,98
MOTA ENGIL	2,152	-2,27	33,66
NAVIGATOR	3,602	-1,10	0,06
NOS	5,710	-2,48	7,84
NOVABASE	2,520	0,40	24,75
PHAROL	0,156	-1,27	-4,41
RAMADA	7,660	-0,52	2,13
REN	13,360	-2,77	1,98
SEMAPA	0,860	-2,27	1,30
SONAE CAP.	0,943	-1,51	16,42
SONAE SGPS	7,660	-0,52	2,13

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	0,97
NOVABASE	0,40
SEMAPA	-2,27
NOS	-2,48
REN	-2,77
BCP	-3,30
CTT	-3,57



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.107,86	-1,78%	7,96%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.313,16	-1,93%	12,31%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.350,71	-1,95%	11,64%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.973,92	-1,69%	13,40%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.843,57	-1,24%	13,44%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.095,20	-1,43%	6,50%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.402,13	-0,93%	6,93%	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.