

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

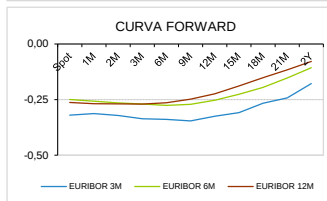
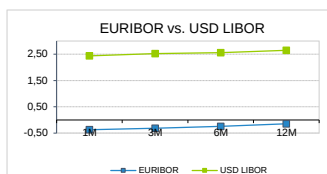
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

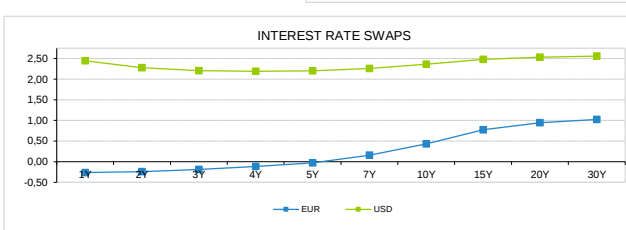
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	2,4360	-1	-4	0,7309	-0,7976
3M	-0,3130	0	0	3M	2,5234	0	-6	0,8043	-0,7126
6M	-0,2440	0	-1	6M	2,5598	1	-7	0,9016	-0,6558
12M	-0,1450	-1	-3	12M	2,6469	1	-10	1,0458	-0,5186

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2623	0	-3	-0,2252	0,1198	0,5414
2Y	-0,2420	-1	-4	-0,1508	0,2266	0,6484
3Y	-0,1880	0	-6	-0,0603	0,3311	0,7511
4Y	-0,1140	0	-8	0,0388	0,4366	0,8440
5Y	-0,0280	0	-9	0,1387	0,5395	0,9320
7Y	0,1570	0	-10	0,3412	0,7260	1,0760
10Y	0,4330	1	-11	0,6150	0,9436	1,2230
15Y	0,7740	1	-12	0,9091	1,1361	1,3240
20Y	0,9440	1	-12	1,0488	1,2061	1,3260
30Y	1,0240	1	-12	1,0968	1,1914	1,2580

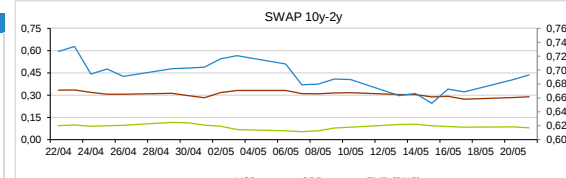
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,4470	1	-16	2,1436	2,1756	2,3903
2Y	2,2800	1	-23	2,1151	2,2303	2,3900
3Y	2,2080	0	-24	2,1351	2,2806	2,4570
4Y	2,1910	0	-24	2,1220	2,3120	2,4950
5Y	2,2030	0	-24	2,1630	2,3570	2,5540
7Y	2,2600	0	-23	2,2790	2,4558	2,5890
10Y	2,3610	0	-23	2,4092	2,5210	2,6350
15Y	2,4810	-1	-22	2,4980	2,5880	2,6630
20Y	2,5350	-1	-21	2,5616	2,6060	2,6570
30Y	2,5590	-1	-21	2,5765	2,5915	2,6185

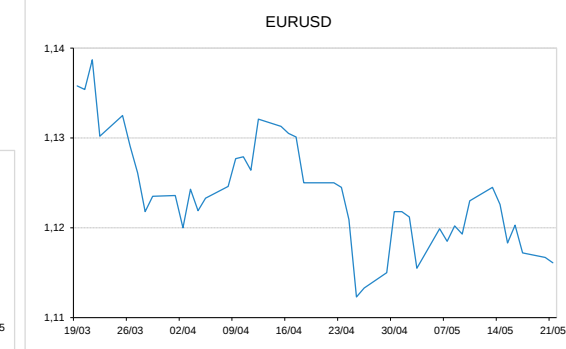
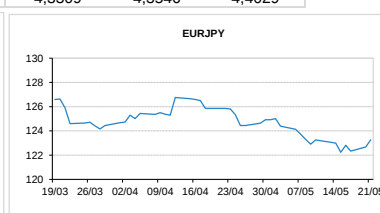


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	71,86	-0,11	0,43	OT 2Y	-0,379	-0,02	-2,50
JETFUEL	690,25	-3,50	21,75	OT 5Y	0,048	-0,01	-8,30
DIESEL	656,25	-2,75	17,50	OT 10Y	1,034	-0,02	-14,00
COBRE	6.033,50	-27,00	-447,00	BUND 10Y	-0,474	2,44	-8,80
ZINCO	2.648,25	-19,25	-139,75	SCHATZ 2Y	-0,002	1,38	-4,30
OURO	1.274,13	-2,07	-1,61	T-NOTE 10Y	3,168	1,77	-10,10
TRIGO	485,75	7,50	37,50	T-NOTE 2Y	2,650	2,91	-9,70
LICENÇA C02	25,33	0,13	-1,56	GILT 10Y	1,005	2,37	-11,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1161	-0,05%	-0,79%	1,1247	1,1333	1,1500
EUR/GBP	0,8761	0,01%	-1,30%	0,8788	0,8817	0,8881
EUR/JPY	123,27	-0,49%	2,10%	123,27	123,27	123,27
EUR/CHF	1,1276	-0,13%	1,40%	1,1265	1,1255	1,1234
EUR/BRL	4,5389	0,76%	-2,38%	4,6105	4,6803	4,8143
EUR/PLN	4,3084	-0,21%	-0,56%	4,3309	4,3546	4,4029



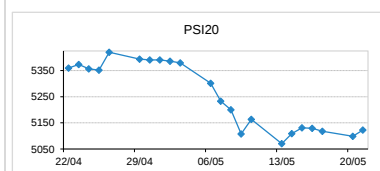
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1161	0,8761	123,27	1,1276	10,7809	7,4685	1,4983	1,6229	4,5389	9,7906
USD	0,8945	-	0,7819	110,585	1,0095	9,6456	6,6802	1,3412	1,4529	4,0636	8,7536

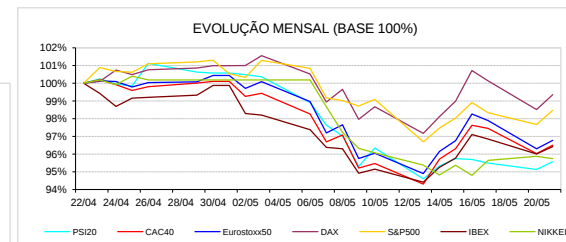
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,180	0,24	6,55
BCP	0,253	1,40	10,11
CORT. AMORIM	10,400	0,78	15,56
CTT	2,240	1,54	-23,96
EDP	3,263	1,02	7,02
EDP R	8,760	1,98	12,67
GALP	14,400	0,95	4,39
IBERSOL	8,100	1,50	2,53
J MARTINS	13,320	1,72	28,82
MOTA ENGIL	2,168	3,83	34,66
NAVIGATOR	3,422	1,00	-4,94
NOS	5,840	-0,76	10,29
NOVABASE	2,430	1,67	20,30
PHAROL	0,153	0,66	-6,25
RAMADA	7,700	1,05	2,67
REN	12,980	0,62	-0,92
SEMAPA	0,880	-0,56	3,65
SONAE CAP.	0,905	-0,44	11,73
SONAE SGPS	7,700	1,05	2,67

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	3,83
EDP R	1,98
J MARTINS	1,72
NOVABASE	1,67
CTT	1,54
SONAE CAP.	-0,44
SEMAPA	-0,56
NOS	-0,76



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.122,59	0,47%	8,27%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.385,46	0,50%	13,84%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.386,42	0,49%	12,83%	3.595,10	2.908,70
XTRA DAX	12.143,47	0,85%	15,01%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.863,88	0,82%	14,22%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.239,30	0,43%	8,19%	10.156,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.272,45	-0,14%	6,28%	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.