

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

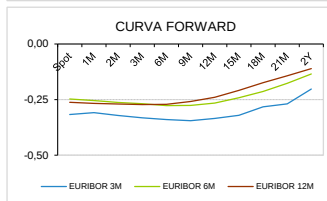
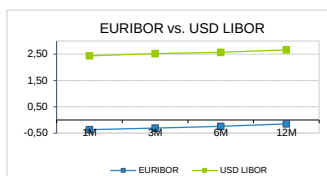
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

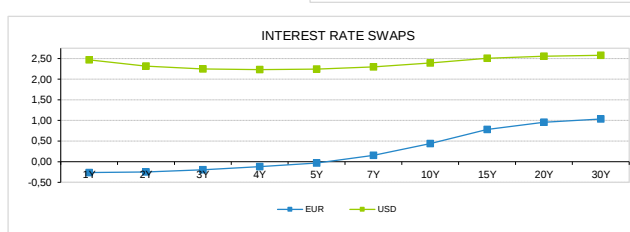
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4370	1	-4	0,7304	-0,7902
3M	-0,3100	0	0	3M	2,5248	0	-6	0,7989	-0,7070
6M	-0,2420	0	-1	6M	2,5706	1	-6	0,9021	-0,6564
12M	-0,1480	0	-4	12M	2,6656	1	-8	1,0484	-0,5202

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2620	0	-3	-0,2411	0,0690	0,4760
2Y	-0,2470	0	-5	-0,1751	0,1715	0,5830
3Y	-0,1950	0	-7	-0,0932	0,2730	0,6840
4Y	-0,1190	0	-8	-0,0023	0,3770	0,7830
5Y	-0,0330	0	-9	0,0945	0,4790	0,8660
7Y	0,1560	0	-10	0,2915	0,6675	1,0170
10Y	0,4380	0	-10	0,5632	0,8865	1,1680
15Y	0,7820	0	-11	0,8597	1,0839	1,2730
20Y	0,9550	0	-11	1,0019	1,1571	1,2770
30Y	1,0350	0	-10	1,0526	1,1450	1,2120

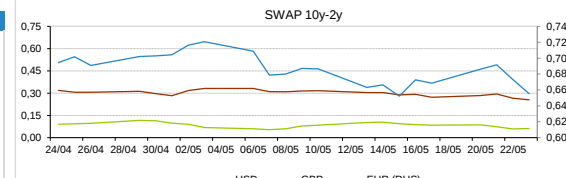
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,4670	2	-13	2,0568	2,0220	2,2440
2Y	2,3150	4	-16	1,9565	2,0800	2,2930
3Y	2,2490	5	-17	1,9820	2,1370	2,3380
4Y	2,2320	4	-17	2,0170	2,1840	2,3780
5Y	2,2430	4	-17	2,0615	2,2320	2,4364
7Y	2,2960	4	-16	2,1500	2,3140	2,4740
10Y	2,3930	4	-16	2,2842	2,4070	2,5270
15Y	2,5080	3	-16	2,3820	2,4770	2,5550
20Y	2,5580	3	-16	2,4290	2,4970	2,5500
30Y	2,5790	3	-16	2,4490	2,4945	2,5275

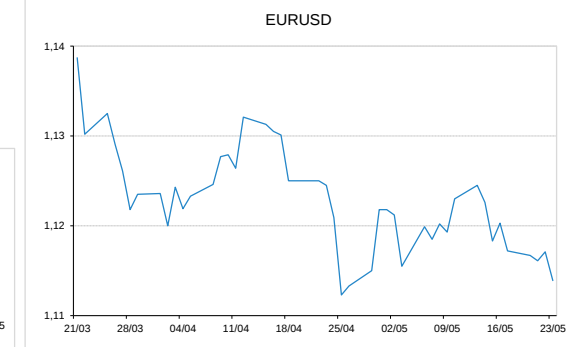
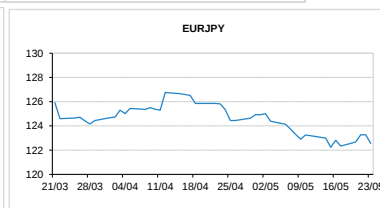
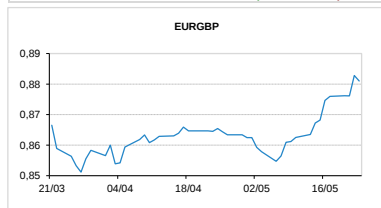


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	67,94	-3,05	-5,95	OT 2Y	-0,387	0,00	-4,90
JETFUEL	642,00	-25,50	-38,75	OT 5Y	0,029	-0,02	-12,50
DIESEL	613,00	-25,00	-37,25	OT 10Y	1,013	-0,01	-18,90
COBRE	5.931,50	-68,00	-548,00	BUND 10Y	-0,531	-3,85	-16,60
ZINCO	2.622,00	-32,50	-166,00	SCHATZ 2Y	-0,014	-0,69	-6,00
OURO	1.285,99	11,19	13,21	T-NOTE 10Y	3,078	-5,61	-19,20
TRIGO	483,75	11,00	38,75	T-NOTE 2Y	2,561	-6,97	-16,20
LICENÇA C02	26,10	-0,27	-1,43	GILT 10Y	0,874	-7,42	-27,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1139	-0,29%	-0,94%	1,1225	1,1309	1,1470
EUR/GBP	0,881	0,20%	-1,87%	0,8837	0,8866	0,8925
EUR/JPY	122,56	0,58%	2,66%	122,56	122,56	122,56
EUR/CHF	1,1217	0,32%	2,07%	1,1206	1,1195	1,1173
EUR/BRL	4,5077	-0,09%	-2,33%	4,5788	4,6454	4,7722
EUR/PLN	4,3041	0,04%	-0,47%	4,3261	4,3486	4,3948



FIXINGS CONTRA USD e EUR

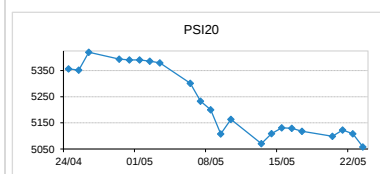
	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1139	0,8810	122,56	1,1217	10,7515	7,4686	1,5046	1,6193	4,5077	9,7782
USD	0,8969	-	0,7894	109,745	1,0066	9,6416	6,6983	1,3472	1,4519	4,0341	8,7666

ACCIONISTA

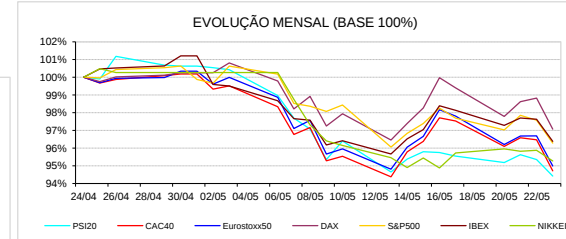
TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,130	-2,70	5,69
BCP	0,251	-0,12	9,19
CORT. AMORIM	10,580	-0,56	17,56
CTT	2,298	-0,35	-22,00
EDP	3,263	-0,18	7,02
EDP R	8,770	-0,34	12,80
GALP	13,965	-2,92	1,23
IBERSOL	8,080	-0,25	2,28
J MARTINS	13,415	-0,63	29,74
MOTA ENGIL	2,088	-3,06	29,69
NAVIGATOR	3,350	-1,59	-6,94
NOS	5,560	-0,63	5,00
NOVABASE	2,360	-1,67	16,83
PHAROL	0,147	-2,51	-9,68
RAMADA	7,640	-0,78	1,87
REN	12,800	-1,99	-2,29
SEMAPA	0,815	0,00	-4,00
SONAE CAP.	0,886	-1,17	9,38
SONAE SGPS	7,640	-0,78	1,87

MAIORES GANHOS/PERDAS

Título	Variação %
REN	-1,99
PHAROL	-2,51
ALTRI	-2,70
GALP	-2,92
MOTA ENGIL	-3,06



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.057,92	-0,98%	6,90%	5.733,18	4.551,84
CAC40	5.281,37	-1,81%	11,64%	5.626,02	4.555,99
ESTX 50 PR	3.327,20	-1,76%	10,85%	3.580,67	2.908,70
XTRA DAX	11.952,41	-1,78%	13,20%	13.170,05	10.279,20
S&P 500	2.818,40	-1,33%	12,43%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.114,00	-1,28%	6,72%	10.100,80	8.286,20
NIKKEI 225	21.151,14	-0,62%	5,68%	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.