

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

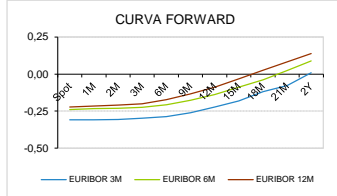
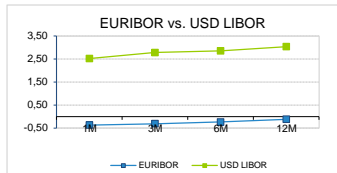
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

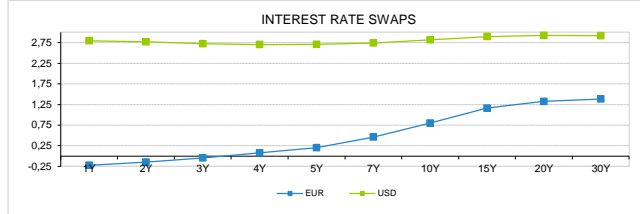
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,5190	1	1	0,7344	-0,7806
3M	-0,3080	0	0	3M	2,7793	1	-4	0,9248	-0,7004
6M	-0,2370	0	0	6M	2,8536	0	-5	1,0326	-0,6438
12M	-0,1160	0	0	12M	3,0371	0	-4	1,1588	-0,5082

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2225	0	1	-0,0883	0,4045	0,9467
2Y	-0,1490	0	1	0,0263	0,5417	1,0693
3Y	-0,0440	0	0	0,1524	0,6761	1,1826
4Y	0,0760	0	-2	0,2844	0,8032	1,2817
5Y	0,2030	0	-3	0,4146	0,9223	1,3675
7Y	0,4590	0	-4	0,6630	1,1289	1,5141
10Y	0,7970	-1	-3	0,9670	1,3419	1,6438
15Y	1,1610	-1	-2	1,2626	1,5139	1,7117
20Y	1,3250	-1	-1	1,3867	1,5602	1,6850
30Y	1,3830	-1	0	1,4100	1,5235	1,5964

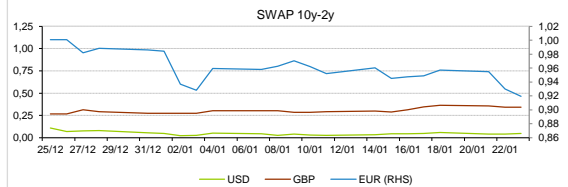
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7940	2	-2	2,6972	2,5645	2,7608
2Y	2,7670	4	-4	2,6000	2,6040	2,7650
3Y	2,7210	5	-5	2,5890	2,6530	2,8145
4Y	2,7030	6	-6	2,6030	2,6840	2,8440
5Y	2,7070	6	-6	2,6290	2,7230	2,9034
7Y	2,7410	5	-5	2,6860	2,7940	2,9220
10Y	2,8160	5	-5	2,7967	2,8635	2,9520
15Y	2,8980	5	-4	2,8480	2,9030	2,9545
20Y	2,9220	4	-4	2,8690	2,9245	2,9360
30Y	2,9160	4	-4	2,8540	2,8730	2,8930

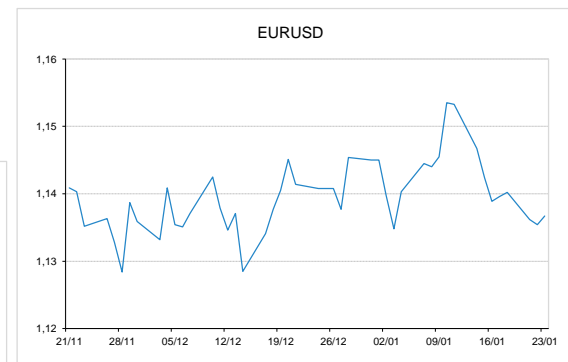
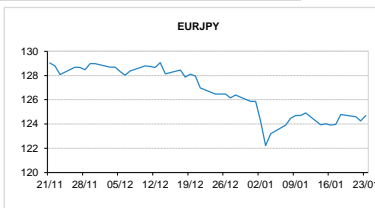
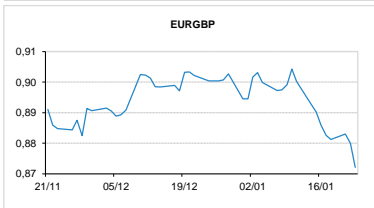


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	60,65	-0,85	6,55	OT 2Y	-0,173	-0,01	17,50
JETFUEL	606,25	2,25	47,07	OT 5Y	0,525	-0,01	11,30
DIESEL	570,91	3,41	50,73	OT 10Y	1,714	-0,02	2,70
COBRE	5.932,50	-46,00	-56,00	BUND 10Y	-0,345	-1,45	-9,60
ZINCO	2.598,50	-8,00	88,00	SCHATZ 2Y	0,039	0,23	-0,90
OURO	1.285,26	1,56	28,08	T-NOTE 10Y	3,442	0,99	-0,90
TRIGO	523,25	2,00	9,25	T-NOTE 2Y	2,918	0,39	3,10
LICENÇA C02	24,73	-0,48	-0,19	GILT 10Y	1,548	0,39	7,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1367	0,11%	-0,36%	1,1455	1,1545	1,1736
EUR/GBP	0,87213	0,90%	3,24%	0,8749	0,8779	0,8846
EUR/JPY	124,7	-0,36%	1,42%	124,70	124,70	124,70
EUR/CHF	1,1328	0,05%	-0,46%	1,1317	1,1305	1,1282
EUR/BRL	4,3288	-0,11%	2,86%	4,3911	4,4571	4,5938
EUR/PLN	4,2912	-0,16%	-0,24%	4,3138	4,3369	4,3855



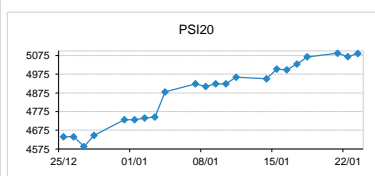
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1367	0,8721	124,70	1,1328	10,2661	7,4667	1,5222	1,59702	4,3288	9,7798
USD	0,8788	-	0,7656	109,635	0,9958	9,0171	6,5615	1,3355	1,4019	3,8007	8,5869

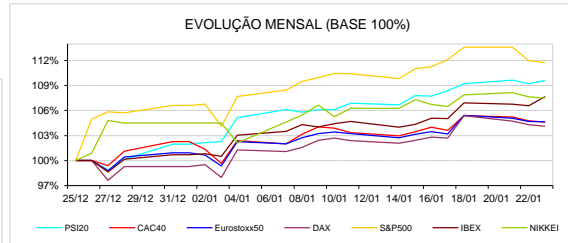
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,070	2,32	21,90
BCP	0,242	0,83	5,45
CORT. AMORIM	9,630	0,31	7,00
CTT	3,118	0,78	5,84
EDP	3,048	0,26	-0,03
EDP R	7,885	-1,19	1,41
GALP	13,900	-1,73	0,76
IBERSOL	8,680	0,00	9,87
J MARTINS	12,780	2,65	23,60
MOTA ENGIL	1,756	0,80	9,07
NAVIGATOR	4,160	0,63	15,56
NOS	5,505	-0,09	3,97
NOVABASE	2,260	1,35	11,88
PHAROL	0,182	1,00	11,40
REN	2,546	-0,16	4,60
SEMAPA	15,120	-0,26	15,42
SONAE CAP.	0,874	-0,57	2,94
SONAE SGPS	0,927	1,04	14,44

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
J MARTINS	2,65
ALTRI	2,32
NOVABASE	1,35
SONAE SGPS	1,04
PHAROL	1,00
REN	-0,16
SEMAPA	-0,26
SONAE CAP.	-0,57
EDP R	-1,19
GALP	-1,73



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.086,01	0,34%	7,49%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.840,38	-0,15%	2,32%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.112,13	-0,02%	3,69%	3.687,22	2.908,70
XTRA DAX	11.071,54	-0,17%	4,85%	13.596,89	10.279,20
S&P 500	2.628,15	-0,19%	4,83%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.128,80	1,01%	6,90%	10.643,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.593,72	-0,14%	2,89%	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.