

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

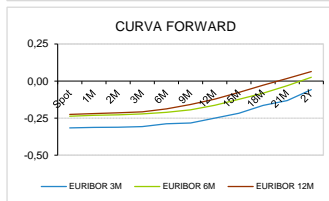
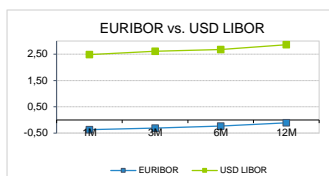
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

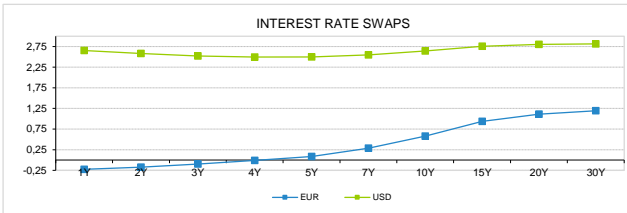
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4838	0	-1	0,7283
3M	-0,3090	0	0	3M	2,6109	2	-7	0,8426
6M	-0,2320	0	0	6M	2,6764	-1	-7	0,9684
12M	-0,1090	0	0	12M	2,8590	-1	-6	1,1088
								-0,5030

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2250	0	-1	-0,1245	0,2774	0,6945
2Y	-0,1750	-1	-1	-0,0292	0,3825	0,8015
3Y	-0,0990	-1	-2	0,0735	0,4865	0,9045
4Y	-0,0110	-1	-3	0,1762	0,5915	1,0035
5Y	0,0850	-1	-4	0,2795	0,6935	1,0990
7Y	0,2850	-1	-6	0,4855	0,8870	1,2560
10Y	0,5780	-1	-9	0,7680	1,1129	1,3950
15Y	0,9350	-1	-8	1,0702	1,3057	1,4930
20Y	1,1110	-1	-7	1,2091	1,3730	1,4920
30Y	1,1940	-1	-5	1,2580	1,3580	1,4270

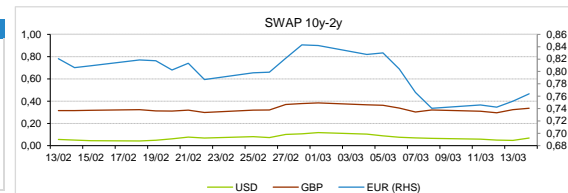
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suiza	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6550	-2	-5	2,4938	2,4165	2,5985
2Y	2,5810	-2	-6	2,4150	2,4370	2,6510
3Y	2,5200	-2	-7	2,4270	2,4890	2,7010
4Y	2,4960	-2	-8	2,4260	2,5644	2,7460
5Y	2,4980	-2	-8	2,4789	2,6129	2,8092
7Y	2,5460	-2	-8	2,5580	2,6800	2,8480
10Y	2,6430	-2	-6	2,6727	2,7740	2,8940
15Y	2,7580	-2	-5	2,7570	2,8360	2,9130
20Y	2,8020	-2	-4	2,8176	2,8490	2,9030
30Y	2,8150	-2	-2	2,8030	2,8596	2,8670

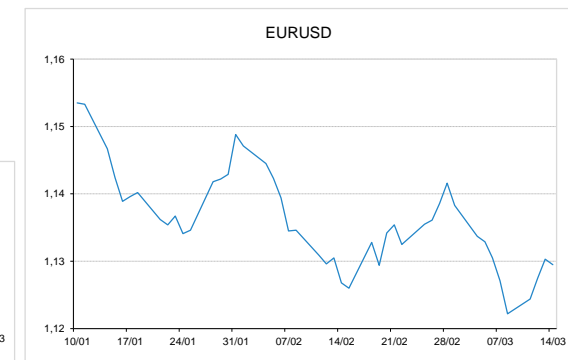
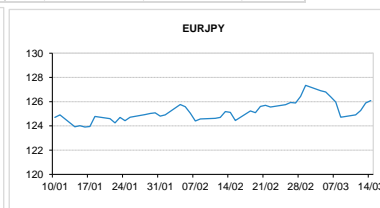


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	67,37	-0,18	2,85	OT 2Y	-0,244	0,00	-2,70
JETFUEL	650,15	5,40	21,90	OT 5Y	0,244	0,00	-15,80
DIESEL	613,90	1,15	15,40	OT 10Y	1,332	-0,01	-30,60
COBRE	6.466,00	0,50	347,50	BUND 10Y	-0,308	2,26	-5,10
ZINCO	2.885,00	11,00	283,00	SCHATZ 2Y	0,069	0,23	0,20
OURO	1.295,85	-12,77	-18,35	T-NOTE 10Y	3,317	1,96	-4,60
TRIGO	458,00	10,75	-52,50	T-NOTE 2Y	2,788	0,78	-2,70
LICENÇA C02	22,65	0,37	2,87	GILT 10Y	1,166	2,69	4,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1295	-0,07%	0,24%	1,1382	1,1469	1,1647
EUR/GBP	0,85228	0,77%	3,19%	0,8550	0,8578	0,8639
EUR/JPY	126,09	-0,16%	-0,77%	126,09	126,09	126,09
EUR/CHF	1,1348	0,08%	0,04%	1,1338	1,1327	1,1305
EUR/BRL	4,3443	-0,48%	-3,28%	4,4083	4,4764	4,6092
EUR/PLN	4,3032	-0,05%	0,76%	4,3241	4,3451	4,3886



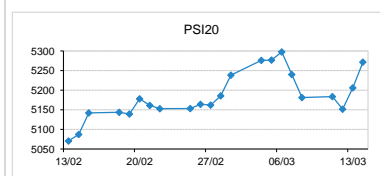
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1295	0,8523	126,09	1,1348	10,5199	7,4625	1,5052	1,6006	4,3443	9,6971
USD	0,8848	-	0,755	111,605	1,0043	9,3209	6,6028	1,3323	1,4177	3,8312	8,5879

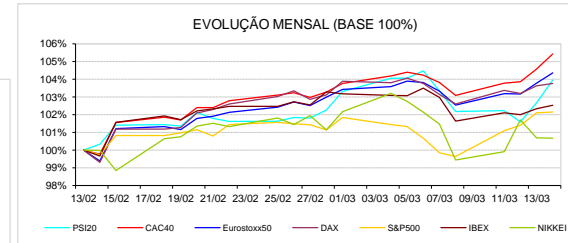
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,750	8,24	33,62
BCP	0,227	-0,44	-1,00
CORT. AMORIM	10,700	0,19	18,89
CTT	2,816	0,50	-4,41
EDP	3,349	1,36	9,84
EDP R	8,760	1,39	12,67
GALP	14,690	0,96	6,49
IBERSOL	8,040	0,50	1,77
J MARTINS	13,130	1,31	26,98
MOTA ENGIL	2,195	1,62	36,34
NAVIGATOR	4,334	1,50	20,39
NOS	5,540	2,59	4,63
NOVABASE	2,520	0,00	24,75
PHAROL	0,190	2,92	16,54
REN	2,668	0,08	9,61
SEMAPA	15,100	0,67	15,27
SONAE CAP.	0,883	-0,79	4,00
SONAE SGPS	0,942	0,53	16,30

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	8,24
PHAROL	2,92
NOS	2,59
MOTA ENGIL	1,62
NAVIGATOR	1,50
BCP	-0,44
SONAE CAP.	-0,79



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.271,55	1,26%	11,41%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.349,78	0,82%	13,09%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.342,03	0,56%	11,35%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.587,47	0,13%	9,74%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.812,18	0,04%	12,18%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.209,80	0,19%	7,84%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.287,02	-0,02%	6,36%	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.