

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

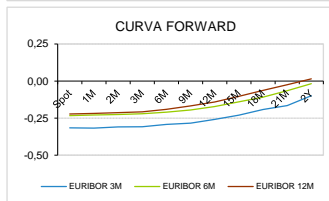
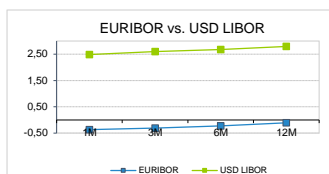
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

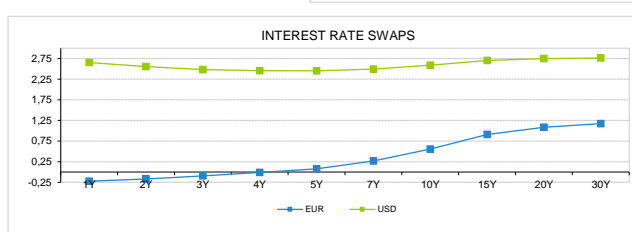
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4855	-1	0	0,7310	-0,7862
3M	-0,3090	0	0	3M	2,6015	-1	-5	0,8387	-0,7112
6M	-0,2280	0	0	6M	2,6774	0	-3	0,9624	-0,6516
12M	-0,1080	0	0	12M	2,7941	-2	-9	1,0944	-0,5006

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2220	0	-1	-0,1407	0,1882	0,5620
2Y	-0,1710	0	-1	-0,0627	0,2780	0,6600
3Y	-0,0950	-1	-2	0,0205	0,3732	0,7610
4Y	-0,0110	-1	-4	0,1069	0,4650	0,8558
5Y	0,0780	-2	-5	0,1970	0,5649	0,9425
7Y	0,2690	-3	-7	0,3855	0,7490	1,0820
10Y	0,5550	-3	-9	0,6471	0,9576	1,2240
15Y	0,9090	-3	-9	0,9274	1,1427	1,3220
20Y	1,0840	-3	-8	1,0618	1,2114	1,3260
30Y	1,1730	-2	-6	1,1132	1,2037	1,2690

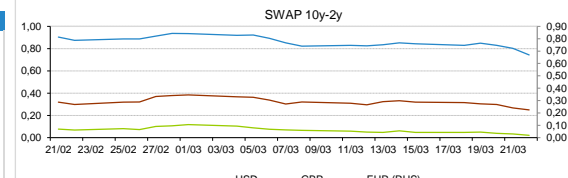
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6530	-1	-5	2,2338	2,1680	2,3860
2Y	2,5560	-1	-6	2,1520	2,2260	2,4110
3Y	2,4850	-2	-8	2,1490	2,2615	2,4565
4Y	2,4550	-2	-9	2,1790	2,3280	2,5170
5Y	2,4530	-2	-9	2,2340	2,3550	2,5760
7Y	2,4950	-3	-10	2,2940	2,4370	2,6050
10Y	2,5880	-3	-9	2,4240	2,5380	2,6605
15Y	2,7020	-4	-8	2,5220	2,6115	2,6905
20Y	2,7480	-4	-7	2,5685	2,6320	2,6860
30Y	2,7630	-4	-6	2,5880	2,6280	2,6610

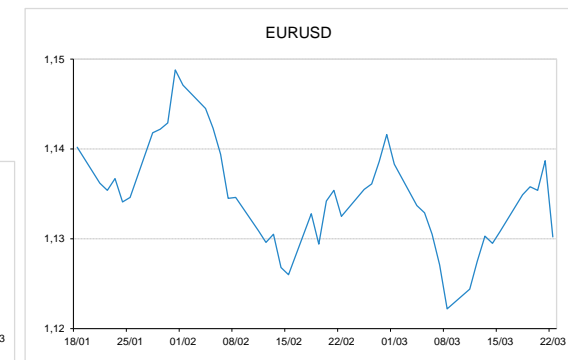
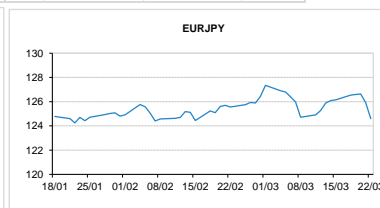
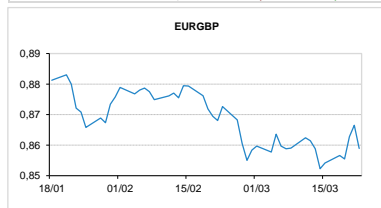


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	66,50	-1,36	-0,75	OT 2Y	-0,269	0,00	-3,60
JETFUEL	637,00	-12,25	-18,08	OT 5Y	0,201	-0,02	-15,10
DIESEL	601,75	-14,00	-25,08	OT 10Y	1,261	-0,02	-25,80
COBRE	6.432,50	-36,00	41,00	BUND 10Y	-0,421	-6,30	-12,70
ZINCO	2.869,50	-27,00	170,50	SCHATZ 2Y	0,048	-1,61	-1,20
OURO	1.312,23	4,28	-20,63	T-NOTE 10Y	3,168	-7,76	-17,10
TRIGO	466,00	-0,50	-25,75	T-NOTE 2Y	2,642	-9,70	-17,10
LICENÇA C02	20,59	-0,35	1,65	GILT 10Y	0,928	-5,27	-19,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1302	-0,75%	-0,20%	1,1390	1,1476	1,1643
EUR/GBP	0,8589	0,88%	1,60%	0,8616	0,8644	0,8699
EUR/JPY	124,6	1,06%	0,77%	124,60	124,60	124,60
EUR/CHF	1,1223	0,50%	1,03%	1,1213	1,1202	1,1179
EUR/BRL	4,3978	-1,88%	-3,44%	4,4591	4,5294	4,6002
EUR/PLN	4,3008	-0,28%	0,84%	4,3218	4,3431	4,3858



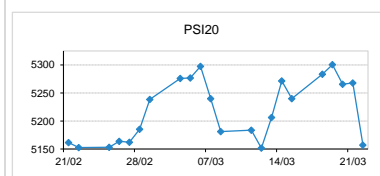
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1302	0,8589	124,60	1,1223	10,4878	7,4630	1,5141	1,59379	4,3978	9,6807
USD	0,8865	-	0,7585	109,945	0,9949	9,2957	6,6154	1,3418	1,4107	3,8888	8,5724

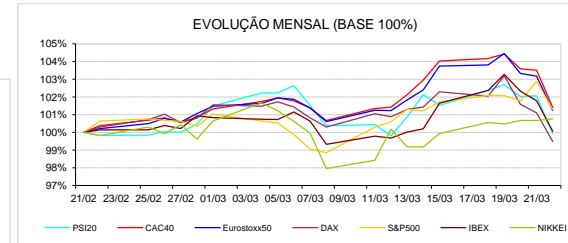
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,980	-3,46	20,34
BCP	0,221	-2,86	-3,88
CORT. AMORIM	10,580	-1,12	17,56
CTT	2,650	-1,19	-10,05
EDP	3,439	0,56	12,79
EDP R	8,510	-1,90	9,45
GALP	13,885	-2,46	0,65
IBERSOL	7,920	-1,25	0,25
J MARTINS	13,270	-1,52	28,34
MOTA ENGIL	2,085	-6,08	29,50
NAVIGATOR	4,070	-3,74	13,06
NOS	5,575	-0,98	5,29
NOVABASE	2,530	-0,78	25,25
PHAROL	0,195	-5,57	19,49
REN	2,584	-2,20	6,16
SEMAPA	14,620	-2,01	11,60
SONAE CAP.	0,871	-3,01	2,59
SONAE SGPS	0,928	-5,40	14,57

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP	0,56
ALTRI	-3,46
NAVIGATOR	-3,74
SONAE SGPS	-5,40
PHAROL	-5,57
MOTA ENGIL	-6,08



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.157,04	-2,10%	8,99%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.269,47	-2,03%	11,39%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.304,14	-1,88%	10,09%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.364,18	-1,61%	7,63%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.810,82	-1,54%	12,13%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.196,80	-1,70%	7,69%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.627,34	0,09%	8,06%	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.