

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

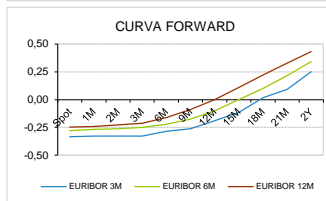
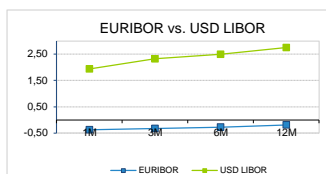
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

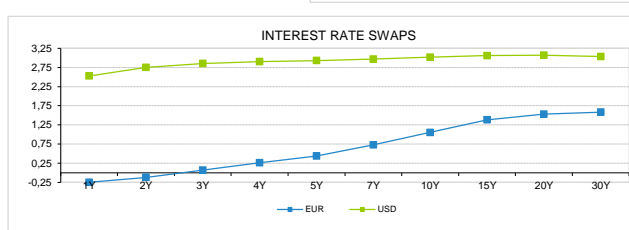
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	1,9388	1	4	0,4999	-0,7823
3M	-0,3260	0	0	3M	2,3206	-1	-3	0,6403	-0,7156
6M	-0,2720	0	0	6M	2,4925	-1	0	0,7593	-0,6432
12M	-0,1880	0	0	12M	2,7539	0	2	0,9299	-0,5160

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2485	0	1	-0,0005	0,8446	1,3910
2Y	-0,1190	1	2	0,2175	0,9931	1,4830
3Y	0,0690	1	3	0,4257	1,1245	1,5700
4Y	0,2630	2	5	0,6038	1,2330	1,6500
5Y	0,4380	2	7	0,7573	1,3340	1,7160
7Y	0,7270	2	8	1,0078	1,5020	1,8290
10Y	1,0530	3	9	1,2878	1,6724	1,9210
15Y	1,3840	2	9	1,5474	1,8106	1,9700
20Y	1,5320	2	9	1,6544	1,8379	1,9360
30Y	1,5820	2	9	1,6680	1,7887	1,8450

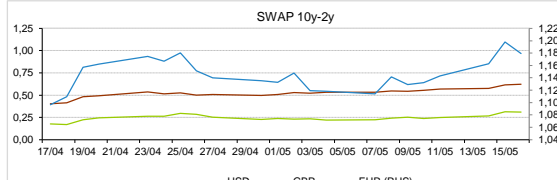
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5290	-2	2	3,0498	3,1390	3,1770
2Y	2,7480	-2	8	3,0740	3,1430	3,1470
3Y	2,8510	-1	10	3,1206	3,1300	3,1740
4Y	2,9010	-1	12	3,1011	3,1510	3,1690
5Y	2,9310	-1	13	3,1110	3,1620	3,2304
7Y	2,9680	0	14	3,1130	3,1850	3,2150
10Y	3,0160	0	15	3,1685	3,2010	3,1940
15Y	3,0580	0	14	3,1870	3,1835	3,1815
20Y	3,0690	1	14	3,1560	3,1810	3,1740
30Y	3,0340	1	13	3,1260	3,1210	3,1055

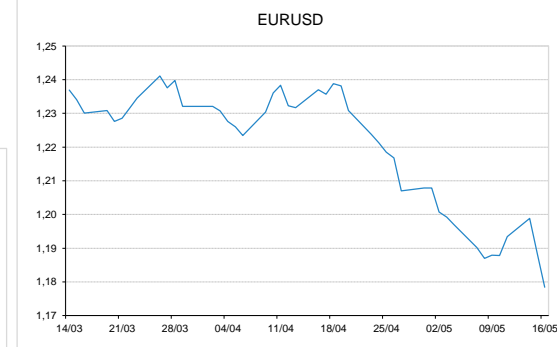
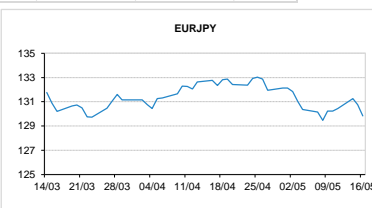
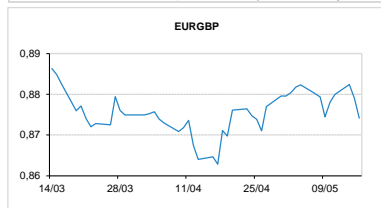


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	78,23	-0,20	7,42	OT 2Y	-0,121	0,05	7,60
JETFUEL	734,33	-3,50	46,58	OT 5Y	0,639	0,04	4,90
DIESEL	690,08	-2,50	52,08	OT 10Y	1,807	0,07	15,90
COBRE	6.810,00	-77,00	-22,00	BUND 10Y	0,131	-3,89	6,70
ZINCO	3.057,75	8,50	-61,25	SCHATZ 2Y	0,041	-2,53	-0,30
OURO	1.289,97	-1,48	-58,06	T-NOTE 10Y	3,748	-0,34	19,80
TRIGO	492,75	-0,75	13,75	T-NOTE 2Y	2,953	-0,39	13,60
LICENÇA C02	15,16	0,84	1,16	GILT 10Y	1,655	-0,97	2,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1784	-0,83%	-4,74%	1,1868	1,1955	1,2153
EUR/GBP	0,87418	0,55%	-1,09%	0,8765	0,8790	0,8849
EUR/JPY	129,83	0,72%	2,26%	129,83	129,83	129,83
EUR/CHF	1,1793	0,67%	0,69%	1,1781	1,1769	1,1748
EUR/BRL	4,3383	-0,28%	-2,46%	4,4046	4,4670	4,6089
EUR/PLN	4,2806	0,23%	-2,95%	4,3034	4,3260	4,3741



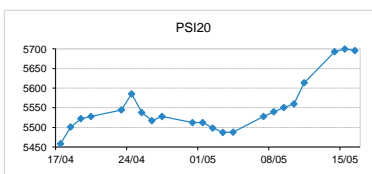
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1784	0,8742	129,83	1,1793	10,2732	7,4482	1,5117	1,57039	4,3383	9,5603
USD	0,8483	-	0,7417	110,3	1,0007	8,7222	6,3183	1,2803	1,3324	3,6856	8,1065

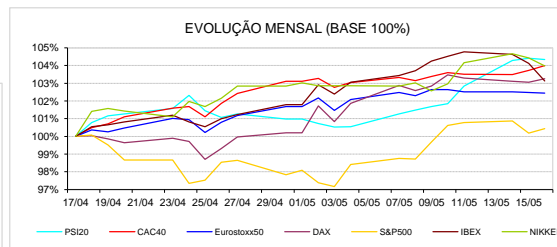
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,550	13,19	46,01
BCP	0,282	-1,64	3,53
CORT. AMORIM	11,2800	-0,35	9,51
CTT	2,9280	2,31	-16,51
EDP	3,400	-1,16	17,85
EDP R	8,030	-0,56	15,26
GALP	16,950	-0,76	10,60
IBERSOL	11,300	-0,44	-7,00
J MARTINS	13,815	0,47	-14,70
MOTA ENGIL	3,560	0,71	-2,81
NAVIGATOR	5,375	2,58	26,41
NOS	4,826	-0,54	-11,95
NOVABASE	2,830	0,35	-7,18
PHAROL	0,263	-1,13	5,00
REN	2,614	-1,36	5,45
SEMAPA	20,550	4,63	15,48
SONAE CAP.	1,016	0,00	14,54
SONAE SGPS	1,136	0,98	0,89

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	13,19
SEMAPA	4,63
NAVIGATOR	2,58
CTT	2,31
SONAE SGPS	0,98
GALP	-0,76
PHAROL	-1,13
EDP	-1,16
REN	-1,36
BCP	-1,64



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.695,67	-0,07%	5,70%	5.793,38	5.014,62
CAC40	5.567,54	0,26%	4,80%	5.570,96	4.995,07
ESTX 50 PR	3.562,85	-0,04%	1,68%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.996,33	0,20%	0,61%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.718,49	0,26%	1,68%	2.872,87	2.352,72
IBEX 35	10.111,00	-0,95%	0,67%	11.048,00	9.327,60
NIKKEI 225	22.717,23	-0,44%	-0,21%	24.129,34	19.239,52



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.