

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

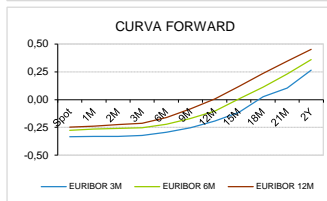
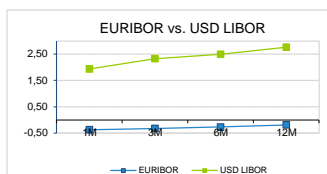
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

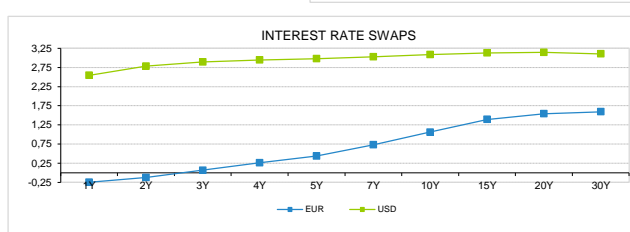
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	1,9350	0	4	0,4968	-0,7863
3M	-0,3260	0	0	3M	2,3256	1	-3	0,6269	-0,7266
6M	-0,2700	0	0	6M	2,4944	0	-1	0,7509	-0,6452
12M	-0,1880	0	0	12M	2,7615	1	2	0,9339	-0,5200

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2475	0	1	0,0032	0,8707	1,4241
2Y	-0,1220	0	2	0,2278	1,0276	1,5184
3Y	0,0670	0	3	0,4410	1,1332	1,6069
4Y	0,2630	0	4	0,6240	1,2691	1,6878
5Y	0,4380	0	5	0,7799	1,3696	1,7480
7Y	0,7310	0	7	1,0330	1,5390	1,8475
10Y	1,0610	1	8	1,3160	1,7092	1,9656
15Y	1,3940	1	8	1,5792	1,8476	2,0162
20Y	1,5440	1	9	1,6896	1,8779	1,9806
30Y	1,5950	1	9	1,7050	1,8327	1,8941

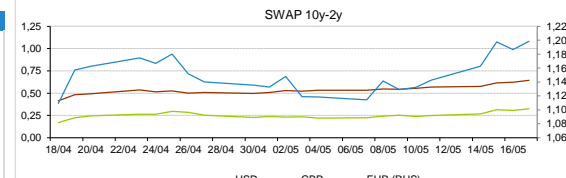
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



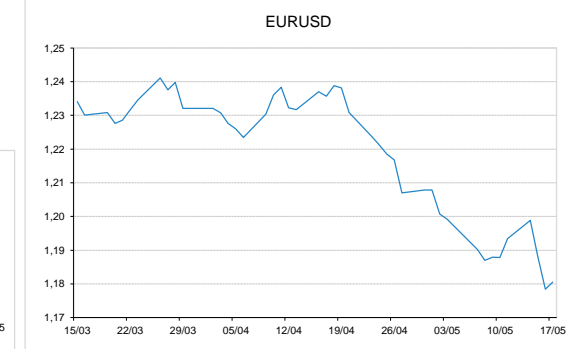
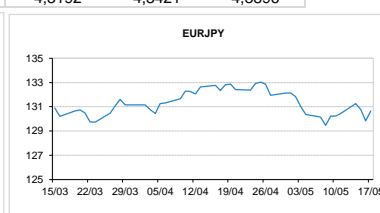
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5460	2	4	3,0634	3,1660	3,1960
2Y	2,7820	3	11	3,0895	3,1640	3,2000
3Y	2,8920	4	14	3,1405	3,1760	3,2150
4Y	2,9470	5	16	3,1548	3,1820	3,2290
5Y	2,9810	5	18	3,1480	3,1950	3,2673
7Y	3,0290	6	20	3,1640	3,2190	3,2570
10Y	3,0850	7	22	3,2000	3,2360	3,2580
15Y	3,1300	7	22	3,2180	3,2400	3,2410
20Y	3,1410	7	21	3,2080	3,2140	3,2080
30Y	3,1060	7	20	3,1590	3,1485	3,1420



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	80,19	0,91	9,22	OT 2Y	-0,153	-0,03	3,80
JETFUEL	752,25	17,92	71,75	OT 5Y	0,632	-0,01	6,90
DIESEL	707,75	17,67	76,00	OT 10Y	1,803	0,00	18,60
COBRE	6.844,50	18,00	-84,50	BUND 10Y	0,165	2,67	11,50
ZINCO	3.075,50	17,75	-63,00	SCHATZ 2Y	0,053	0,46	1,20
OURO	1.290,44	-1,30	-56,48	T-NOTE 10Y	3,765	0,68	22,50
TRIGO	502,00	7,75	20,50	T-NOTE 2Y	2,949	-1,56	12,80
LICENÇA C02	15,29	0,11	1,55	GILT 10Y	1,711	5,76	9,80


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1805	0,18%	-4,47%	1,1887	1,1975	1,2171
EUR/GBP	0,8735	0,08%	-1,23%	0,8758	0,8784	0,8844
EUR/JPY	130,66	-0,64%	1,29%	130,66	130,66	130,66
EUR/CHF	1,1811	-0,01%	1,10%	1,1799	1,1787	1,1767
EUR/BRL	4,3738	-0,87%	-3,73%	4,4417	4,5069	4,6545
EUR/PLN	4,2969	-0,48%	-3,17%	4,3192	4,3421	4,3896

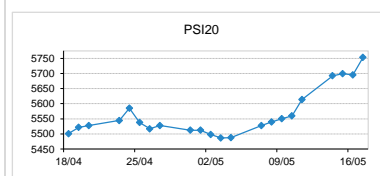

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1805	0,8735	130,66	1,1811	10,3117	7,4478	1,5121	1,57115	4,3738	9,5830
USD	0,8480	-	0,7405	110,815	1,0023	8,7397	6,3155	1,2796	1,3306	3,6856	8,1093

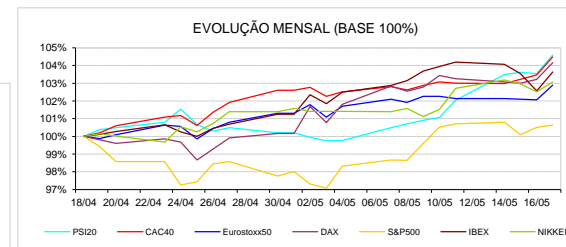
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,650	1,32	47,94
BCP	0,286	1,53	5,11
CORT. AMORIM	11,4600	1,60	11,26
CTT	2,9700	1,43	-15,31
EDP	3,401	0,03	17,89
EDP R	8,220	2,37	17,98
GALP	16,930	-0,12	10,47
IBERSOL	11,350	0,44	-6,58
J MARTINS	13,920	0,76	-14,05
MOTA ENGIL	3,635	2,11	-0,76
NAVIGATOR	5,415	0,74	27,35
NOS	4,936	2,28	-9,94
NOVABASE	2,860	1,06	-6,20
PHAROL	0,277	5,52	10,80
REN	2,620	0,23	5,69
SEMAPA	20,800	1,22	16,89
SONAE CAP.	1,016	0,00	14,54
SONAE SGPS	1,147	0,97	1,87

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	5,52
EDP R	2,37
NOS	2,28
MOTA ENGIL	2,11
CORT. AMORIM	1,60
GALP	-0,12



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.753,69	1,02%	6,78%	5.793,38	5.014,62
CAC40	5.621,92	0,98%	5,82%	5.621,92	4.995,07
ESTX 50 PR	3.592,18	0,82%	2,52%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	13.114,61	0,91%	1,52%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.726,12	0,13%	1,96%	2.872,87	2.352,72
IBEX 35	10.216,40	1,04%	1,72%	11.048,00	9.327,60
NIKKEI 225	22.838,37	0,53%	0,32%	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.