

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

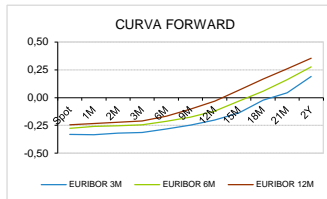
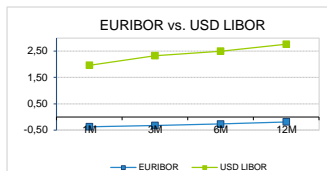
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

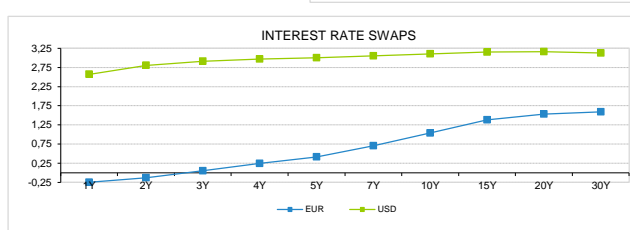
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	1,9654	0	7	0,5002
3M	-0,3230	0	1	3M	2,3300	0	-3	0,6225
6M	-0,2700	0	0	6M	2,4994	0	-1	0,7432
12M	-0,1890	0	0	12M	2,7640	0	0	0,9308
								-0,5228

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2455	0	1	-0,0312	0,7488	1,3171
2Y	-0,1270	0	2	0,1629	0,8935	1,4181
3Y	0,0530	0	1	0,3576	1,0363	1,5065
4Y	0,2440	1	1	0,5265	1,1547	1,5890
5Y	0,4170	1	1	0,6810	1,2580	1,6620
7Y	0,7080	1	2	0,9395	1,4355	1,7760
10Y	1,0410	1	3	1,2285	1,6229	1,8860
15Y	1,3820	1	4	1,5072	1,7767	1,9450
20Y	1,5340	0	6	1,6225	1,8115	1,9175
30Y	1,5910	0	7	1,6494	1,7715	1,8355

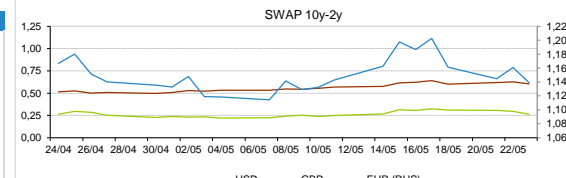
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



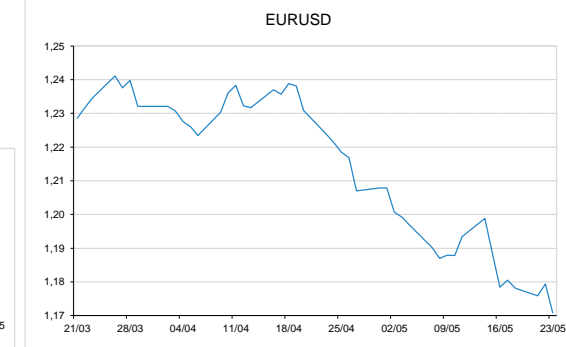
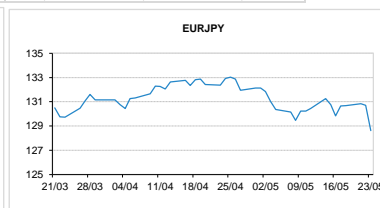
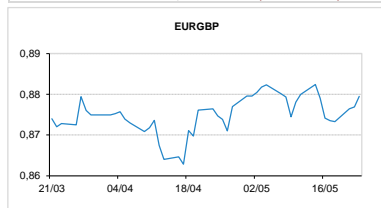
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5720	2	3	3,0017	3,0590	3,0600
2Y	2,8060	2	7	3,0447	3,0545	3,0660
3Y	2,9140	2	9	3,0170	3,0420	3,0805
4Y	2,9700	2	10	3,0215	3,0500	3,0935
5Y	3,0030	1	10	3,0265	3,0620	3,1440
7Y	3,0510	1	12	3,0445	3,1020	3,1350
10Y	3,1060	0	13	3,0910	3,1150	3,1405
15Y	3,1530	0	14	3,1351	3,1572	3,1300
20Y	3,1630	0	13	3,1070	3,1110	3,1050
30Y	3,1270	0	13	3,0580	3,0465	3,0375



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	79,46	-0,11	5,45	OT 2Y	-0,031	0,03	11,60
JETFUEL	746,00	-4,50	45,25	OT 5Y	0,761	0,00	16,70
DIESEL	702,75	-3,75	51,75	OT 10Y	1,956	-0,01	26,00
COBRE	6.963,00	100,00	-13,00	BUND 10Y	0,026	-5,67	-14,10
ZINCO	3.060,00	-50,00	-177,50	SCHATZ 2Y	-0,009	-2,52	-7,80
OURO	1.291,68	-2,60	-32,05	T-NOTE 10Y	3,687	-3,56	1,40
TRIGO	527,00	5,50	52,50	T-NOTE 2Y	2,910	-2,73	2,30
LICENÇA C02	16,02	0,07	3,13	GILT 10Y	1,590	-7,67	-9,50


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1708	-0,73%	-4,33%	1,1793	1,1881	1,2077
EUR/GBP	0,87953	-0,30%	-0,36%	0,8819	0,8844	0,8905
EUR/JPY	128,61	1,63%	2,93%	128,61	128,61	128,61
EUR/CHF	1,1637	0,60%	2,68%	1,1626	1,1613	1,1591
EUR/BRL	4,2594	0,89%	-1,04%	4,3254	4,3893	4,5326
EUR/PLN	4,3102	-0,56%	-2,45%	4,3342	4,3571	4,4060

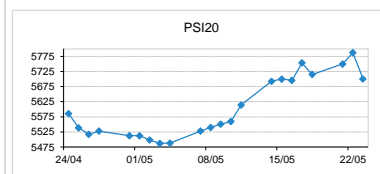

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1708	0,8795	128,61	1,1637	10,2587	7,4495	1,5064	1,55198	4,2594	9,4841
USD	0,8544	-	0,7495	109,945	0,9937	8,7810	6,3651	1,2881	1,3244	3,6495	8,1110

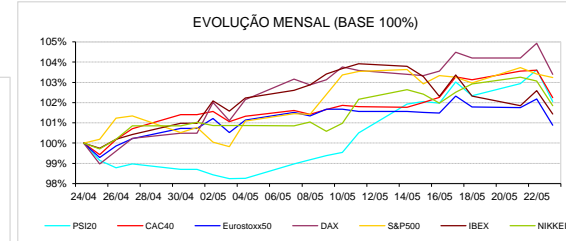
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,770	-0,89	50,26
BCP	0,281	-0,46	3,38
CORT. AMORIM	11,7000	-2,17	13,59
CTT	2,9140	-1,49	-16,91
EDP	3,476	0,75	20,49
EDP R	8,145	-1,21	16,91
GALP	16,685	-2,71	8,87
IBERSOL	11,300	-0,44	-7,00
J MARTINS	13,760	-1,01	-15,04
MOTA ENGIL	3,535	-0,42	-3,49
NAVIGATOR	5,370	-1,10	26,29
NOS	4,700	0,90	-14,25
NOVABASE	2,930	0,00	-3,90
PHAROL	0,279	2,01	11,40
REN	2,470	0,12	-0,36
SEMAPA	21,550	1,41	21,10
SONAE CAP.	1,018	-1,74	14,77
SONAE SGPS	1,152	-0,60	2,31

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	2,01
SEMAPA	1,41
NOS	0,90
EDP	0,75
REN	0,12
EDP R	-1,21
CTT	-1,49
SONAE CAP.	-1,74
CORT. AMORIM	-2,17
GALP	-2,71



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.700,05	-1,51%	5,79%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.565,85	-1,32%	4,77%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.541,82	-1,27%	1,08%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.976,84	-1,47%	0,46%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.719,95	-0,17%	1,73%	2.872,87	2.393,88
IBEX 35	10.025,00	-1,12%	-0,19%	11.048,00	9.327,60
NIKKEI 225	22.689,74	-1,18%	-0,33%	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.