

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

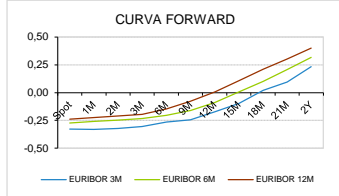
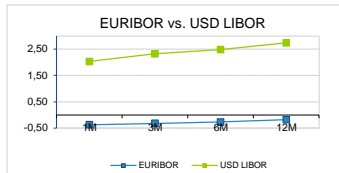
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

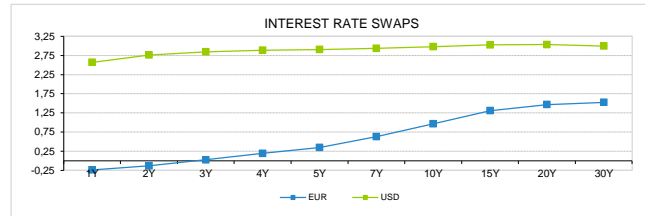
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	2,0296	1	10	0,5019	-0,7896
3M	-0,3210	0	1	3M	2,3209	0	-5	0,6263	-0,7328
6M	-0,2690	0	0	6M	2,4838	0	-4	0,7498	-0,6460
12M	-0,1800	0	1	12M	2,7409	0	-4	0,9236	-0,5258

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2389	0	2	0,0062	0,7730	1,3140
2Y	-0,1300	1	2	0,2016	0,9205	1,4195
3Y	0,0250	2	0	0,3919	1,0520	1,5155
4Y	0,1920	2	-1	0,5605	1,1680	1,6000
5Y	0,3480	2	-2	0,7085	1,2740	1,6760
7Y	0,6280	2	-2	0,9624	1,4515	1,7961
10Y	0,9640	2	-1	1,2484	1,6353	1,8890
15Y	1,3090	2	0	1,5176	1,7807	1,9415
20Y	1,4670	2	1	1,6269	1,8097	1,9090
30Y	1,5250	2	2	1,6418	1,7593	1,8190

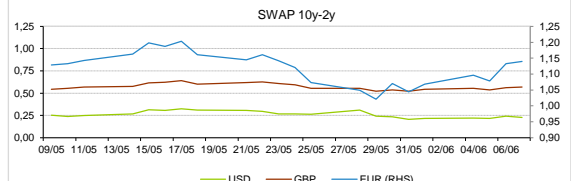
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



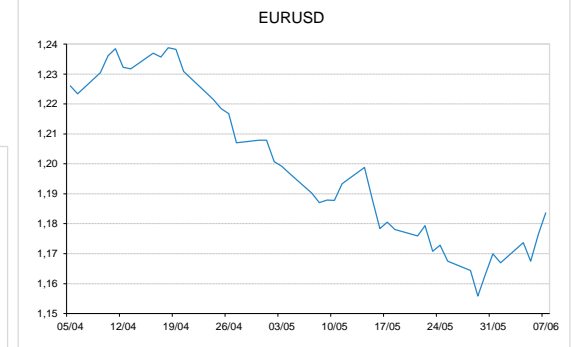
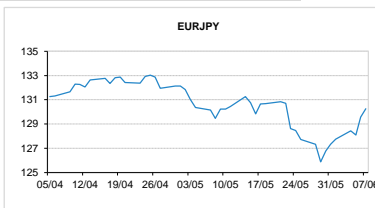
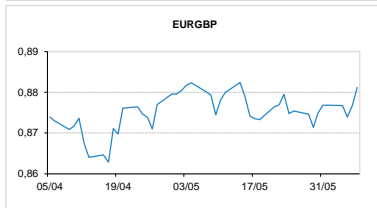
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5690	0	2	2,9895	3,0170	3,0165
2Y	2,7630	0	1	2,9940	3,0155	3,0310
3Y	2,8460	0	0	3,0030	3,0165	3,0460
4Y	2,8840	0	0	3,0040	3,0230	3,0600
5Y	2,9040	0	0	3,0085	3,0330	3,1080
7Y	2,9350	0	0	3,0210	3,0600	3,1000
10Y	2,9810	1	0	3,0555	3,0845	3,1050
15Y	3,0250	0	0	3,0750	3,0910	3,0910
20Y	3,0320	0	-1	3,0650	3,0665	3,0615
30Y	2,9950	0	-1	3,0185	3,0105	2,9990



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	76,89	1,53	1,06	OT 2Y	-0,017	-0,02	16,30
JETFUEL	711,10	13,30	11,10	OT 5Y	0,853	0,07	24,80
DIESEL	669,35	12,55	15,10	OT 10Y	2,031	0,09	29,60
COBRE	7.235,00	121,00	394,00	BUND 10Y	0,004	1,58	-9,90
ZINCO	3.211,50	-8,50	156,50	SCHATZ 2Y	0,011	-1,38	-9,20
OURO	1.297,77	0,14	-16,14	T-NOTE 10Y	3,665	-1,35	-2,30
TRIGO	525,00	5,25	13,50	T-NOTE 2Y	2,957	0,00	-4,70
LICENÇA C02	15,99	0,06	2,37	GILT 10Y	1,636	1,84	-5,20


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1836	0,60%	-0,55%	1,1920	1,2008	1,2206
EUR/GBP	0,88123	-0,50%	-0,13%	0,8836	0,8864	0,8926
EUR/JPY	130,26	-0,53%	-0,08%	130,26	130,26	130,26
EUR/CHF	1,1598	0,12%	3,12%	1,1587	1,1574	1,1551
EUR/BRL	4,6413	-2,22%	-8,77%	4,7180	4,7894	4,9862
EUR/PLN	4,2721	-0,20%	-0,24%	4,2944	4,3164	4,3625

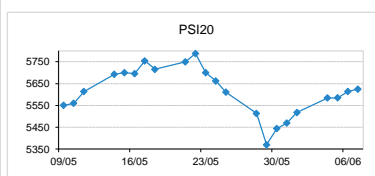

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1836	0,8812	130,26	1,1598	10,2572	7,4482	1,5341	1,54922	4,6413	9,5046
USD	0,8456	-	0,7454	109,985	0,9821	8,6738	6,2986	1,2970	1,3085	3,8890	8,0368

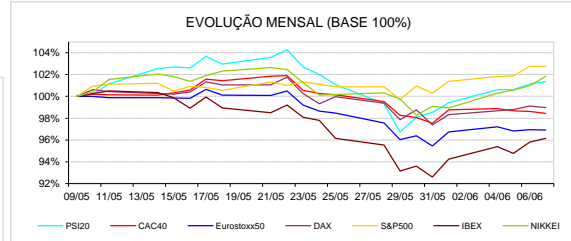
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	8,520	4,16	64,77
BCP	0,271	0,56	-0,55
CORT. AMORIM	11,2200	-1,58	8,93
CTT	2,8440	-0,49	-18,91
EDP	3,370	-1,17	16,81
EDP R	8,200	-0,24	17,70
GALP	16,405	1,42	7,05
IBERSOL	10,900	2,35	-10,29
J MARTINS	13,450	-0,52	-16,95
MOTA ENGIL	3,260	-1,66	-11,00
NAVIGATOR	5,695	0,98	33,94
NOS	4,662	0,04	-14,94
NOVABASE	2,770	0,73	-9,15
PHAROL	0,263	0,38	5,20
REN	2,364	0,34	-4,64
SEMAPA	23,100	1,54	29,81
SONAE CAP.	0,965	1,58	8,79
SONAE SGPS	1,095	-0,73	-2,75

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	4,16
IBERSOL	2,35
SONAE CAP.	1,58
SEMAPA	1,54
GALP	1,42
J MARTINS	-0,52
SONAE SGPS	-0,73
EDP	-1,17
CORT. AMORIM	-1,58
MOTA ENGIL	-1,66



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.624,61	0,20%	4,39%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.448,36	-0,17%	2,56%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.459,77	-0,03%	-1,26%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.811,05	-0,15%	-0,83%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.771,75	-0,02%	3,68%	2.872,87	2.405,70
IBEX 35	9.829,00	0,38%	-2,14%	11.048,00	9.327,60
NIKKEI 225	22.823,26	0,87%	0,26%	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.