

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

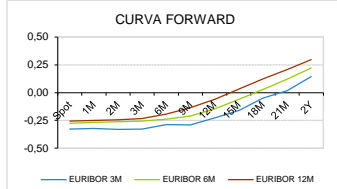
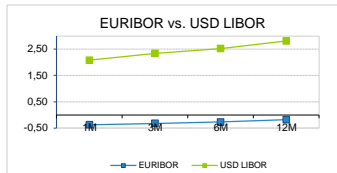
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

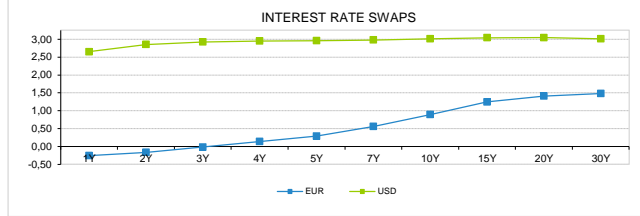
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,0769	1	-3	0,6414	-0,7762
3M	-0,3200	0	0	3M	2,3369	0	0	0,7916	-0,7236
6M	-0,2690	0	0	6M	2,5225	0	2	0,8918	-0,6484
12M	-0,1790	0	0	12M	2,8078	0	4	1,0401	-0,5148

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2553	0	0	-0,0608	0,6383	1,1715
2Y	-0,1620	-1	1	0,1179	0,7770	1,2690
3Y	-0,0170	-1	3	0,2901	0,9073	1,3700
4Y	0,1400	-1	3	0,4450	1,0210	1,4620
5Y	0,2900	-1	3	0,5881	1,1290	1,5460
7Y	0,5590	-2	3	0,8350	1,3190	1,6680
10Y	0,8940	-2	1	1,1310	1,5147	1,7850
15Y	1,2470	-2	0	1,4121	1,6747	1,8530
20Y	1,4110	-2	-1	1,5353	1,7190	1,8310
30Y	1,4820	-2	-2	1,5674	1,6890	1,7570

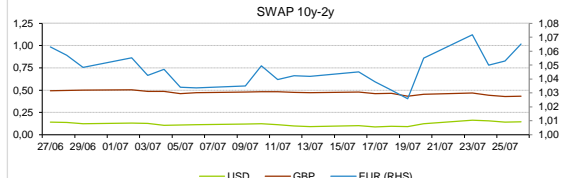
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



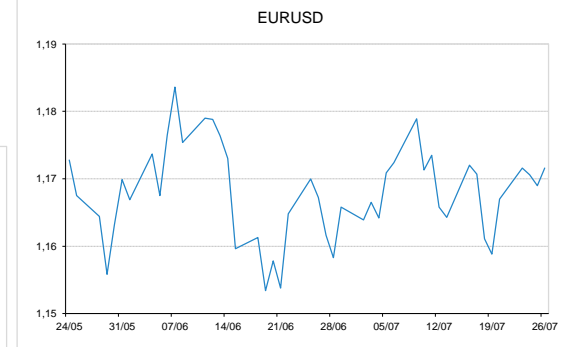
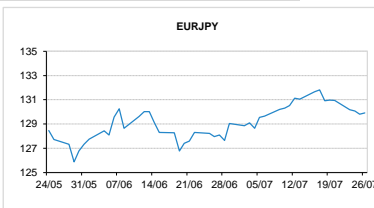
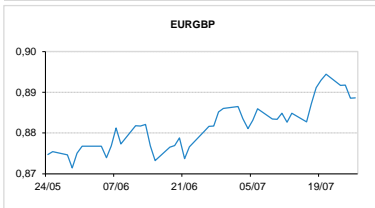
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6500	1	4	3,0747	2,9950	2,9775
2Y	2,8550	2	5	3,0520	3,0225	2,9940
3Y	2,9230	2	5	3,0315	2,9940	3,0080
4Y	2,9490	2	5	3,0240	3,0212	3,0298
5Y	2,9620	2	5	3,0220	3,0050	3,0667
7Y	2,9800	2	5	3,0210	3,0300	3,0620
10Y	3,0130	2	5	3,0665	3,0510	3,0690
15Y	3,0430	1	4	3,0540	3,0600	3,0530
20Y	3,0450	1	4	3,0691	3,0612	3,0568
30Y	3,0140	1	4	3,0299	3,0161	3,0068



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	74,49	0,56	-1,65	OT 2Y	-0,176	-0,04	-8,20
JETFUEL	710,42	8,09	15,17	OT 5Y	0,531	-0,03	-20,00
DIESEL	667,92	7,34	12,67	OT 10Y	1,731	0,00	-15,30
COBRE	6.305,50	-5,00	-465,00	BUND 10Y	-0,163	1,33	-0,70
ZINCO	2.595,50	-29,00	-269,00	SCHATZ 2Y	0,014	-0,23	5,80
OURO	1.226,61	-2,48	-33,23	T-NOTE 10Y	3,661	2,36	6,00
TRIGO	544,00	1,25	61,00	T-NOTE 2Y	3,055	2,35	11,30
LICENÇA C02	17,35	0,01	2,32	GILT 10Y	1,492	0,77	-3,40


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1716	0,22%	0,38%	1,1797	1,1887	1,2078
EUR/GBP	0,8886	-0,01%	-0,79%	0,8912	0,8942	0,9006
EUR/JPY	129,91	-0,08%	-1,51%	129,91	129,91	129,91
EUR/CHF	1,1582	0,21%	-0,26%	1,1571	1,1558	1,1536
EUR/BRL	4,3493	-0,47%	1,80%	4,4205	4,4916	4,6460
EUR/PLN	4,2846	0,42%	1,09%	4,3073	4,3306	4,3788

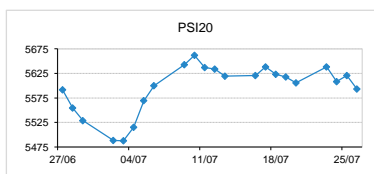

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1716	0,8886	129,91	1,1582	10,2600	7,4507	1,5239	1,57789	4,3493	9,5253
USD	0,8578	-	0,7606	111,055	0,9935	8,8038	6,3912	1,3083	1,3535	3,7289	8,1803

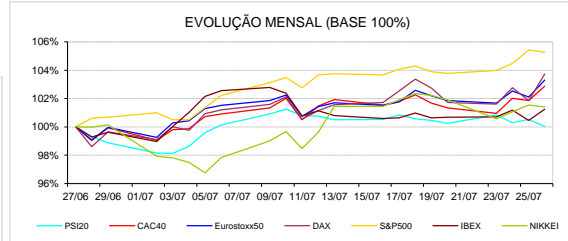
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	8,960	1,93	73,27
BCP	0,269	0,41	-1,29
CORT. AMORIM	11,2800	1,26	9,51
CTT	3,0260	-0,72	-13,72
EDP	3,458	0,38	19,86
EDP R	8,800	0,00	26,31
GALP	17,430	1,69	13,74
IBERSOL	10,150	0,00	0,25
J MARTINS	12,385	-6,81	-23,53
MOTA ENGIL	2,890	0,00	-21,10
NAVIGATOR	4,968	-0,94	17,72
NOS	4,912	0,86	-10,38
NOVABASE	2,710	-0,73	-11,12
PHAROL	0,230	-2,95	-8,00
REN	2,474	-0,08	-0,20
SEMAPA	20,550	-0,96	15,48
SONAE CAP.	0,920	-1,08	3,72
SONAE SGPS	0,955	-2,50	-15,23

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	1,93
GALP	1,69
CORT. AMORIM	1,26
NOS	0,86
BCP	0,41
SEMAPA	-0,96
SONAE CAP.	-1,08
SONAE SGPS	-2,50
PHAROL	-2,95
J MARTINS	-6,81



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.593,01	-0,49%	3,80%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.480,55	1,00%	3,16%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.509,26	1,18%	0,15%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.809,23	1,83%	-0,84%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.842,07	-0,14%	6,30%	2.872,87	2.417,35
IBEX 35	9.780,00	0,79%	-2,63%	10.758,20	9.327,60
NIKKEI 225	22.586,87	-0,12%	-0,78%	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.