

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

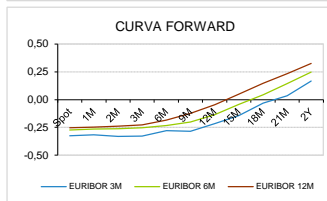
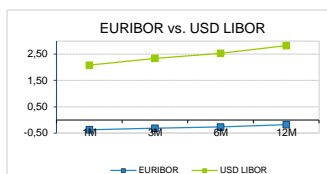
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

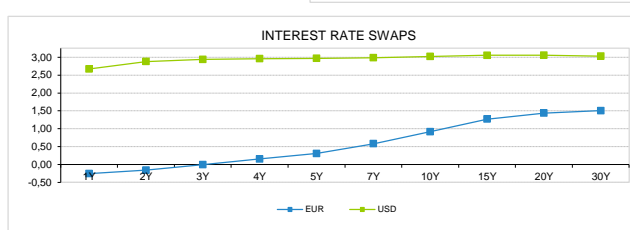
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,0768	1	-2	0,6509	-0,7762
3M	-0,3190	0	0	3M	2,3424	0	1	0,7889	-0,7216
6M	-0,2680	0	0	6M	2,5299	0	3	0,8983	-0,6484
12M	-0,1790	0	0	12M	2,8214	0	6	1,0466	-0,5148

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2537	0	0	-0,0463	0,6729	1,2118
2Y	-0,1570	0	2	0,1385	0,8126	1,3238
3Y	-0,0060	0	4	0,3150	0,9444	1,4210
4Y	0,1540	0	5	0,4727	1,0661	1,5130
5Y	0,3070	0	5	0,6178	1,1740	1,5910
7Y	0,5810	0	5	0,8727	1,3610	1,7194
10Y	0,9180	1	3	1,1660	1,5545	1,8220
15Y	1,2700	1	2	1,4468	1,7124	1,8890
20Y	1,4360	1	2	1,5692	1,7557	1,8670
30Y	1,5060	1	1	1,6024	1,7230	1,7920

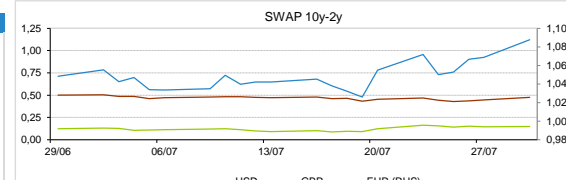
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



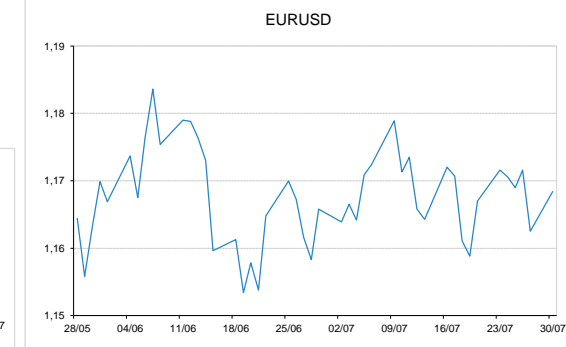
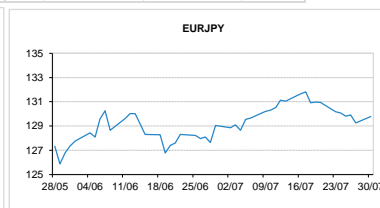
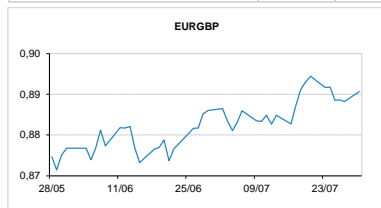
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6710	1	8	3,0840	3,0345	3,0070
2Y	2,8790	2	10	3,0820	3,0020	3,0190
3Y	2,9390	1	10	3,0651	3,0030	3,0575
4Y	2,9610	1	10	3,0529	3,0070	3,0728
5Y	2,9700	0	9	3,0481	3,0210	3,0902
7Y	2,9870	1	10	3,0320	3,0690	3,1114
10Y	3,0210	1	9	3,0580	3,0946	3,0940
15Y	3,0540	1	9	3,0984	3,1017	3,1125
20Y	3,0580	2	9	3,0934	3,0919	3,0879
30Y	3,0310	2	10	3,0573	3,0493	3,0366



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	74,96	0,67	-4,27	OT 2Y	-0,180	-0,02	-7,00
JETFUEL	699,88	-11,62	-23,12	OT 5Y	0,545	0,03	-12,90
DIESEL	658,63	-10,87	-21,53	OT 10Y	1,772	0,05	-6,10
COBRE	6.244,00	6,00	-395,50	BUND 10Y	-0,114	4,08	6,90
ZINCO	2.605,50	14,50	-276,50	SCHATZ 2Y	0,034	1,61	8,20
OURO	1.223,04	-3,08	-32,33	T-NOTE 10Y	3,666	0,51	8,60
TRIGO	546,75	16,25	45,50	T-NOTE 2Y	3,051	-0,39	12,50
LICENÇA C02	17,05	-0,07	2,06	GILT 10Y	1,552	5,29	6,40


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1684	0,51%	0,39%	1,1766	1,1858	1,2050
EUR/GBP	0,8907	-0,28%	-0,47%	0,8934	0,8963	0,9028
EUR/JPY	129,79	-0,42%	-0,72%	129,79	129,79	129,79
EUR/CHF	1,1581	0,09%	-0,28%	1,1569	1,1557	1,1536
EUR/BRL	4,3631	-0,81%	4,37%	4,4357	4,5067	4,6660
EUR/PLN	4,2701	0,37%	3,26%	4,2935	4,3173	4,3648

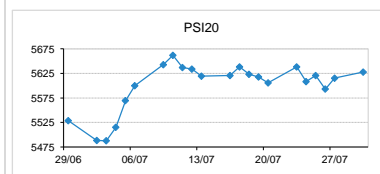

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1684	0,8907	129,79	1,1581	10,2561	7,4486	1,5251	1,5818	4,3631	9,5332
USD	0,8539	-	0,7606	110,975	0,9886	8,7516	6,3605	1,2999	1,3496	3,7278	8,1391

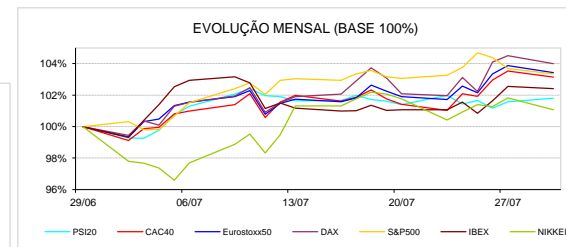
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	8,880	0,11	71,73
BCP	0,266	-0,78	-2,24
CORT. AMORIM	11,4000	-0,70	10,68
CTT	3,0520	0,73	-12,97
EDP	3,533	1,23	22,46
EDP R	8,690	-1,03	24,73
GALP	17,395	-0,63	13,51
IBERSOL	10,200	1,49	0,74
J MARTINS	12,710	1,11	-21,52
MOTA ENGIL	2,885	-0,52	-21,24
NAVIGATOR	4,964	0,73	17,63
NOS	4,972	1,02	-9,29
NOVABASE	2,710	0,00	-11,12
PHAROL	0,231	-0,65	-7,80
REN	2,520	1,20	1,65
SEMAPA	20,450	-1,21	14,92
SONAE CAP.	0,914	0,33	3,04
SONAE SGPS	0,980	0,87	-12,97

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	1,49
EDP	1,23
REN	1,20
J MARTINS	1,11
NOS	1,02
PHAROL	-0,65
CORT. AMORIM	-0,70
BCP	-0,78
EDP R	-1,03
SEMAPA	-1,21



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.627,74	0,22%	4,44%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.491,22	-0,37%	3,36%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.512,31	-0,42%	0,24%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.798,20	-0,48%	-0,92%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.809,56	-0,33%	5,09%	2.872,87	2.417,35
IBEX 35	9.854,10	-0,14%	-1,89%	10.758,20	9.327,60
NIKKEI 225	22.544,84	-0,74%	-0,97%	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.