

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

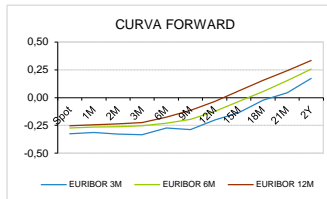
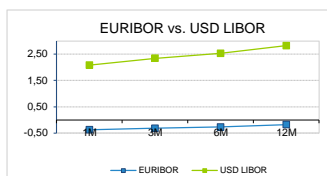
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

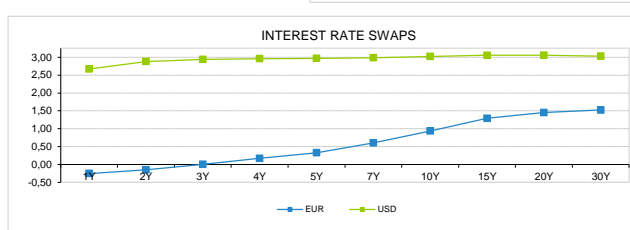
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,0815	0	-1	0,6681	-0,7766
3M	-0,3190	0	0	3M	2,3431	0	1	0,7939	-0,7216
6M	-0,2680	0	0	6M	2,5305	0	3	0,8988	-0,6484
12M	-0,1780	0	0	12M	2,8213	0	6	1,0476	-0,5148

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2520	0	0	-0,0355	0,6775	1,2104
2Y	-0,1490	1	2	0,1480	0,8201	1,3188
3Y	0,0060	1	3	0,3235	0,9488	1,4197
4Y	0,1710	2	4	0,4818	1,0668	1,5020
5Y	0,3270	2	5	0,6248	1,1755	1,5790
7Y	0,6030	2	5	0,8752	1,3550	1,7096
10Y	0,9390	2	4	1,1650	1,5486	1,8140
15Y	1,2890	2	4	1,4427	1,7054	1,8790
20Y	1,4520	2	5	1,5640	1,7472	1,8560
30Y	1,5230	2	6	1,5928	1,7130	1,7810

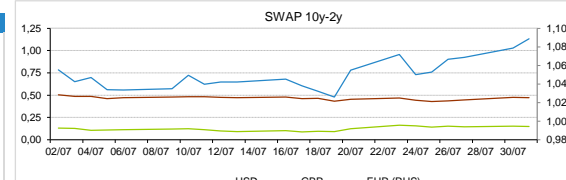
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



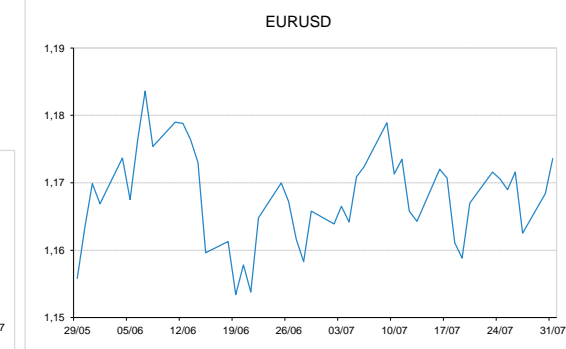
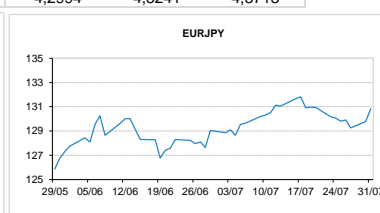
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6710	1	8	3,0742	3,0301	3,0175
2Y	2,8790	2	10	3,0350	3,0198	3,0414
3Y	2,9390	1	10	3,0310	3,0132	3,0553
4Y	2,9610	1	10	3,0250	3,0312	3,0430
5Y	2,9700	0	9	3,0446	3,0140	3,0870
7Y	2,9870	1	10	3,0508	3,0663	3,1080
10Y	3,0210	1	9	3,0771	3,0905	3,1146
15Y	3,0540	1	9	3,0495	3,0962	3,0790
20Y	3,0580	2	9	3,0620	3,0560	3,0395
30Y	3,0310	2	10	3,0500	3,0130	3,0293



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	74,40	-0,57	-4,83	OT 2Y	-0,185	-0,01	-6,40
JETFUEL	700,50	0,62	-22,50	OT 5Y	0,532	-0,01	-10,50
DIESEL	658,50	-0,13	-21,66	OT 10Y	1,741	-0,03	-4,60
COBRE	6.245,00	-47,00	-376,00	BUND 10Y	-0,117	-1,04	7,30
ZINCO	2.567,25	-38,25	-295,25	SCHATZ 2Y	0,046	0,92	8,50
OURO	1.223,95	0,40	-31,42	T-NOTE 10Y	3,660	-0,84	7,80
TRIGO	552,25	5,75	51,00	T-NOTE 2Y	3,047	-0,39	11,30
LICENÇA C02	17,34	0,29	2,35	GILT 10Y	1,544	-1,93	3,60


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1736	0,45%	0,83%	1,1817	1,1912	1,2102
EUR/GBP	0,8922	-0,17%	-0,64%	0,8948	0,8979	0,9043
EUR/JPY	130,84	-0,80%	-1,51%	130,84	130,84	130,84
EUR/CHF	1,1584	-0,06%	-0,30%	1,1573	1,1560	1,1538
EUR/BRL	4,3856	-0,40%	3,84%	4,4565	4,5298	4,6951
EUR/PLN	4,2762	-0,15%	3,11%	4,2994	4,3241	4,3713

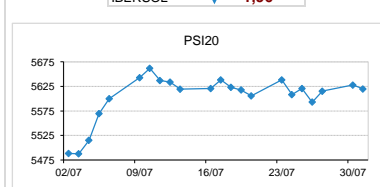

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1736	0,8922	130,84	1,1584	10,2880	7,4505	1,5234	1,57383	4,3856	9,5385
USD	0,8546	-	0,7625	111,925	0,9898	8,7830	6,3667	1,3024	1,3456	3,7565	8,1478

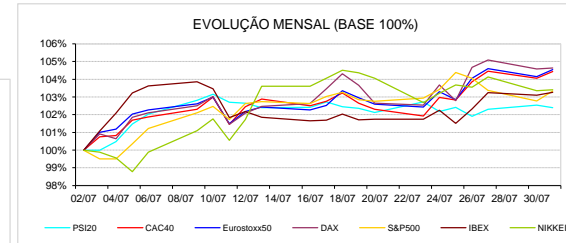
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,750	-1,46	69,21
BCP	0,268	0,94	-1,32
CORT. AMORIM	11,3000	-0,88	9,71
CTT	3,0060	-1,51	-14,29
EDP	3,489	-1,25	20,94
EDP R	8,830	1,61	26,74
GALP	17,590	1,12	14,78
IBERSOL	10,000	-1,96	-1,23
J MARTINS	12,730	0,16	-21,40
MOTA ENGIL	2,865	-0,69	-21,79
NAVIGATOR	4,884	-1,61	15,73
NOS	4,982	0,20	-9,10
NOVABASE	2,710	0,00	-11,12
PHAROL	0,231	0,00	-7,80
REN	2,506	-0,56	1,09
SEMAPA	20,100	-1,71	12,95
SONAE CAP.	0,897	-1,86	1,13
SONAE SGPS	0,973	-0,77	-13,63

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP R	1,61
GALP	1,12
BCP	0,94
NOS	0,20
J MARTINS	0,16
CTT	-1,51
NAVIGATOR	-1,61
SEMAPA	-1,71
SONAE CAP.	-1,86
IBERSOL	-1,96



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.619,80	-0,14%	4,30%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.511,30	0,37%	3,74%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.525,49	0,38%	0,61%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.805,50	0,06%	-0,87%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.818,55	0,55%	5,40%	2.872,87	2.417,35
IBEX 35	9.870,70	0,17%	-1,72%	10.758,20	9.327,60
NIKKEI 225	22.553,72	0,04%	-0,93%	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.