

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

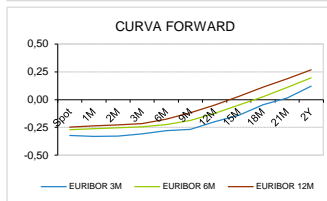
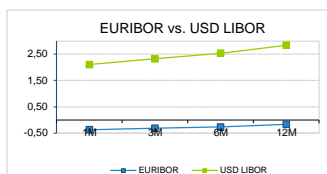
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

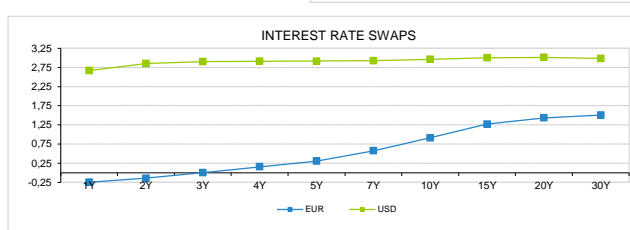
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,1038	3	2	0,7235	-0,7806
3M	-0,3190	0	0	3M	2,3213	1	-2	0,8018	-0,7278
6M	-0,2680	0	0	6M	2,5339	1	0	0,8993	-0,6486
12M	-0,1660	0	1	12M	2,8424	1	2	1,0501	-0,5168

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2468	0	1	-0,0506	0,5677	1,0930
2Y	-0,1420	1	1	0,1098	0,6990	1,2070
3Y	0,0040	1	0	0,2613	0,8373	1,3105
4Y	0,1580	1	-1	0,4030	0,9510	1,4070
5Y	0,3050	1	-2	0,5400	1,0630	1,4930
7Y	0,5750	1	-3	0,7865	1,2575	1,6220
10Y	0,9110	2	-3	1,0835	1,4645	1,7440
15Y	1,2700	1	-2	1,3722	1,6317	1,8140
20Y	1,4350	1	-2	1,4986	1,6804	1,7945
30Y	1,5070	1	-2	1,5341	1,6505	1,7220

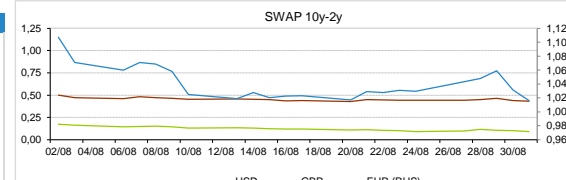
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



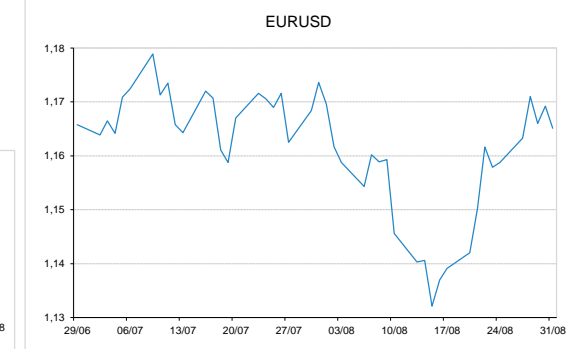
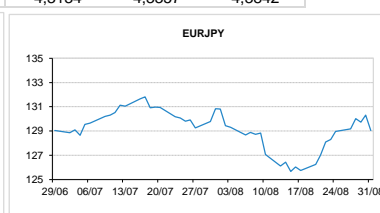
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6680	0	0	2,9795	2,8680	2,8866
2Y	2,8520	1	-3	2,9370	2,8580	2,9032
3Y	2,9010	2	-4	2,9362	2,8814	2,8845
4Y	2,9120	2	-5	2,8990	2,8670	2,9424
5Y	2,9150	2	-6	2,9140	2,9044	2,9632
7Y	2,9280	2	-6	2,9210	2,9357	2,9565
10Y	2,9640	1	-6	2,9540	2,9698	3,0047
15Y	3,0020	1	-5	2,9794	2,9855	2,9750
20Y	3,0100	1	-5	2,9791	2,9465	2,9470
30Y	2,9850	1	-5	2,9250	2,9388	2,9345



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	77,36	-0,41	3,15	OT 2Y	-0,111	0,01	4,20
JETFUEL	725,75	-0,75	25,25	OT 5Y	0,717	0,00	14,90
DIESEL	693,75	0,75	35,25	OT 10Y	1,925	0,01	13,70
COBRE	6.075,50	-20,00	-184,00	BUND 10Y	-0,241	-1,91	-17,30
ZINCO	2.476,50	-43,75	-87,75	SCHATZ 2Y	0,007	0,23	-5,70
OURO	1.201,04	1,76	-25,07	T-NOTE 10Y	3,565	-1,84	-14,90
TRIGO	542,00	7,00	-31,25	T-NOTE 2Y	3,059	-1,57	-9,00
LICENÇA C02	21,08	-0,08	3,68	GILT 10Y	1,574	-2,71	-11,00


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1651	-0,35%	-0,72%	1,1732	1,1824	1,2017
EUR/GBP	0,8974	0,02%	-0,58%	0,9002	0,9031	0,9096
EUR/JPY	129,05	0,98%	1,39%	129,05	129,05	129,05
EUR/CHF	1,1252	0,57%	2,95%	1,1241	1,1229	1,1205
EUR/BRL	4,7908	1,05%	-0,34%	4,8662	4,9462	5,1340
EUR/PLN	4,2916	0,26%	-0,51%	4,3134	4,3357	4,3842

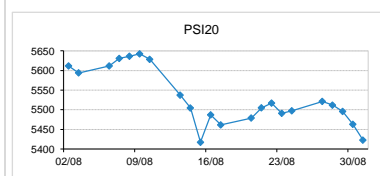

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1651	0,8974	129,05	1,1252	10,6227	7,4556	1,5172	1,61243	4,7908	9,7266
USD	0,8594	-	0,7693	110,87	0,9669	9,1330	6,4068	1,3037	1,3828	4,1212	8,3601

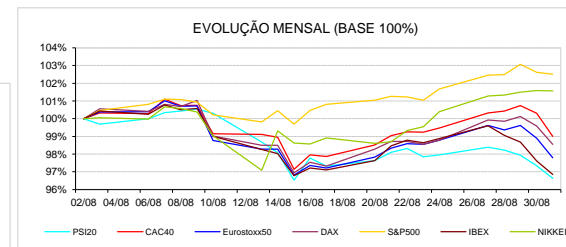
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,960	-1,36	53,94
BCP	0,251	-0,95	-7,79
CORT. AMORIM	11,5000	2,13	11,65
CTT	3,3500	-0,12	-4,48
EDP	3,365	-0,15	16,64
EDP R	8,545	-0,18	22,65
GALP	17,470	-1,91	14,00
IBERSOL	9,600	-0,83	-5,19
J MARTINS	12,905	-0,73	-20,31
MOTA ENIGL	2,675	-4,46	-26,97
NAVIGATOR	4,304	-0,60	-1,99
NOS	4,916	-0,28	-10,31
NOVABASE	2,720	0,37	-10,79
PHAROL	0,207	-0,96	-17,20
REN	2,440	0,16	-1,57
SEMAPA	17,800	-2,31	0,03
SONAE CAP.	0,860	-1,49	-3,04
SONAE SGPS	0,917	-1,08	-18,56

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	2,13
NOVABASE	0,37
REN	0,16
ALTRI	-1,36
SONAE CAP.	-1,49
GALP	-1,91
SEMAPA	-2,31
MOTA ENIGL	-4,46



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.422,58	-0,73%	0,64%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.406,85	-1,30%	1,77%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.392,44	-1,12%	-3,18%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.364,06	-1,04%	-4,29%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.899,39	-0,10%	8,40%	2.916,50	2.446,55
IBEX 35	9.392,50	-0,79%	-6,49%	10.643,40	9.327,60
NIKKEI 225	22.865,15	-0,02%	0,44%	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.