

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

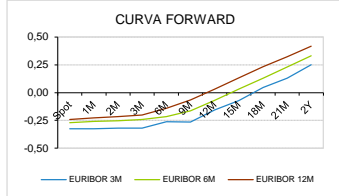
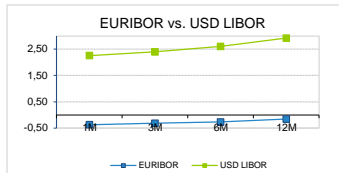
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

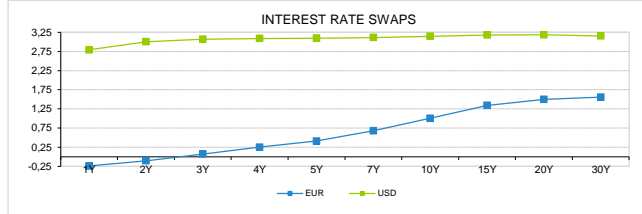
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	2,2560	1	18	0,7224	-0,7796
3M	-0,3180	0	0	3M	2,3960	1	8	0,7984	-0,7336
6M	-0,2680	0	0	6M	2,6005	1	8	0,9003	-0,6546
12M	-0,1590	0	1	12M	2,9174	0	10	1,0611	-0,5188

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2422	0	0	0,0300	0,7430	1,2510
2Y	-0,1020	0	5	0,2248	0,8817	1,3550
3Y	0,0740	0	8	0,3958	1,0036	1,4490
4Y	0,2510	0	11	0,5497	1,1160	1,5330
5Y	0,4100	-1	13	0,6874	1,2180	1,6060
7Y	0,6810	-1	13	0,9276	1,3940	1,7185
10Y	1,0040	-2	12	1,2072	1,5790	1,8330
15Y	1,3440	-2	10	1,4748	1,7282	1,8900
20Y	1,4990	-3	10	1,5843	1,7599	1,8610
30Y	1,5550	-3	8	1,6021	1,7158	1,7760

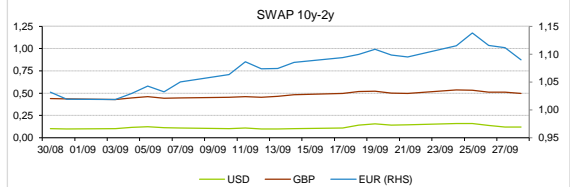
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



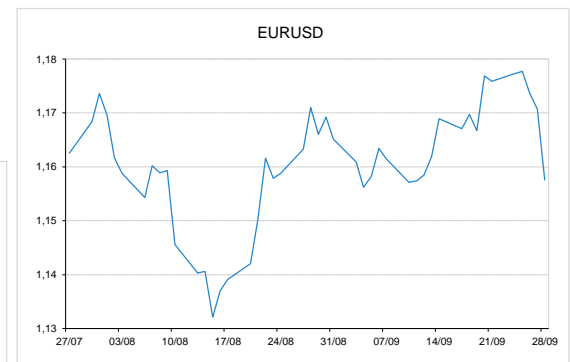
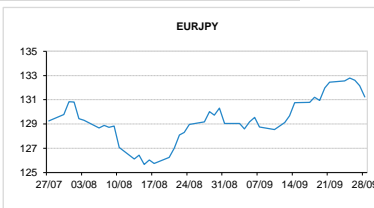
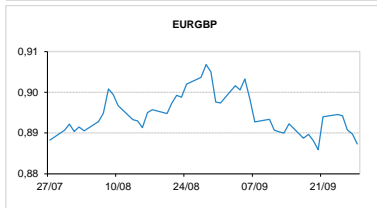
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7920	0	15	3,1726	3,0775	3,0630
2Y	3,0030	-1	19	3,1631	3,0640	3,0890
3Y	3,0700	-1	22	3,1210	3,0680	3,1188
4Y	3,0900	-1	23	3,0910	3,0770	3,1100
5Y	3,0960	-2	24	3,1010	3,0860	3,1529
7Y	3,1130	-2	25	3,0835	3,1309	3,1500
10Y	3,1450	-2	25	3,1270	3,1580	3,1620
15Y	3,1800	-2	24	3,1450	3,1685	3,1540
20Y	3,1850	-2	24	3,1390	3,1320	3,1310
30Y	3,1550	-1	23	3,1010	3,1099	3,1022



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	82,75	1,03	6,46	OT 2Y	-0,082	0,03	5,30
JETFUEL	768,00	12,25	44,75	OT 5Y	0,739	0,01	6,30
DIESEL	728,25	10,75	40,50	OT 10Y	1,880	0,01	-2,10
COBRE	6.179,00	-95,00	82,00	BUND 10Y	0,087	-6,01	6,20
ZINCO	2.525,00	-28,75	-17,50	SCHATZ 2Y	0,103	-2,76	5,30
OURO	1.193,08	8,81	-14,75	T-NOTE 10Y	3,726	-1,02	12,20
TRIGO	508,25	-4,75	-15,00	T-NOTE 2Y	3,208	-1,18	10,60
LICENÇA C02	21,21	0,38	0,52	GILT 10Y	1,707	-2,15	6,90


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1576	-1,12%	-1,14%	1,1669	1,1761	1,1962
EUR/GBP	0,8873	0,27%	2,20%	0,8903	0,8933	0,9000
EUR/JPY	131,23	0,70%	-0,91%	131,23	131,23	131,23
EUR/CHF	1,1342	0,62%	0,72%	1,1329	1,1318	1,1296
EUR/BRL	4,6533	0,35%	3,96%	4,7245	4,8042	4,9975
EUR/PLN	4,2810	-0,19%	-0,31%	4,3046	4,3277	4,3760

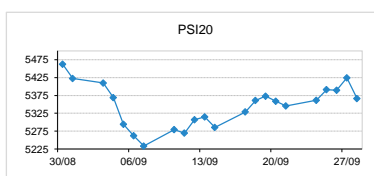

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1576	0,8873	131,23	1,1342	10,3212	7,4570	1,5009	1,60545	4,6533	9,4546
USD	0,8611	-	0,767	113,6	0,9770	8,8929	6,4214	1,2931	1,3825	3,9937	8,1448

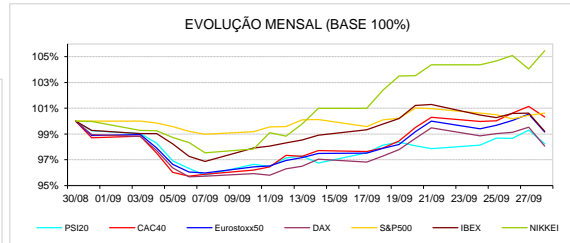
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	8,260	-0,84	59,74
BCP	0,255	-3,48	-6,25
CORT. AMORIM	11,500	-0,17	11,65
CTT	3,376	-0,41	-3,74
EDP	3,178	-3,32	10,16
EDP R	8,740	-0,68	25,45
GALP	17,090	0,89	11,52
IBERSOL	9,400	-1,05	-7,16
J MARTINS	12,685	-0,39	-21,67
MOTA ENGIL	2,100	-4,33	-42,67
NAVIGATOR	4,218	-1,63	-0,05
NOS	5,160	-0,58	-5,86
NOVABASE	2,670	-0,74	-12,43
PHAROL	0,177	-0,90	-29,20
REN	2,430	-0,57	-1,98
SEMAPA	17,120	-0,93	-3,79
SONAE CAP.	0,741	-0,94	-16,46
SONAE SGPS	0,893	-1,11	-20,74

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
GALP	0,89
SONAE SGPS	-1,11
NAVIGATOR	-1,63
EDP	-3,32
BCP	-3,48
MOTA ENGIL	-4,33



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.366,45	-1,07%	-0,41%	5.801,45	5.208,33
CAC40	5.494,00	-0,81%	3,44%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.401,70	-1,39%	-2,92%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.253,01	-1,47%	-5,14%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.918,99	0,17%	9,18%	2.940,91	2.502,93
IBEX 35	9.393,10	-1,43%	-6,50%	10.643,40	9.111,10
NIKKEI 225	24.120,04	1,36%	5,95%	24.286,10	20.285,06



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.