

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

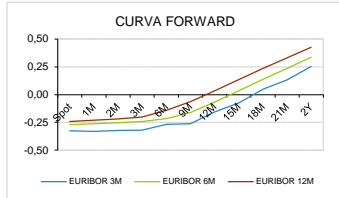
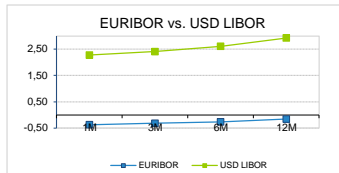
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

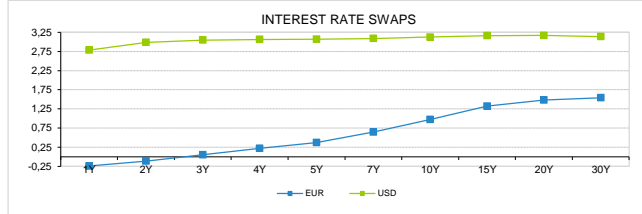
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	2,2739	1	16	0,7213	-0,7766
3M	-0,3180	0	0	3M	2,4075	1	9	0,8014	-0,7370
6M	-0,2670	0	0	6M	2,6070	0	7	0,9042	-0,6546
12M	-0,1570	0	1	12M	2,9248	0	8	1,0681	-0,5204

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2415	0	0	0,0353	0,7590	1,2690
2Y	-0,1120	-1	4	0,2312	0,8970	1,3770
3Y	0,0530	-2	6	0,4050	1,0266	1,4730
4Y	0,2190	-3	8	0,5610	1,1340	1,5580
5Y	0,3710	-3	9	0,7010	1,2390	1,6330
7Y	0,6450	-4	10	0,9450	1,4160	1,7588
10Y	0,9730	-4	9	1,2260	1,6020	1,8570
15Y	1,3200	-3	8	1,4969	1,7522	1,9140
20Y	1,4800	-2	8	1,6077	1,7847	1,8860
30Y	1,5430	-2	7	1,6250	1,7390	1,8010

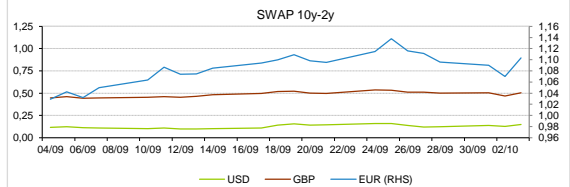
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



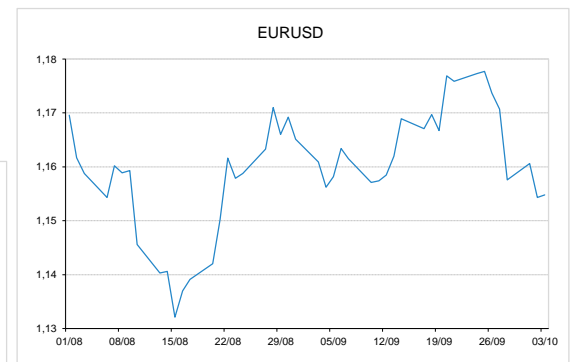
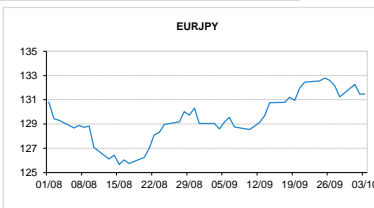
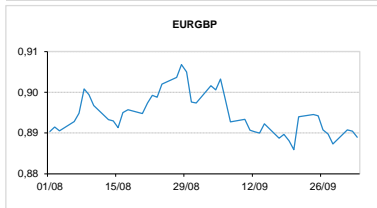
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7850	0	12	3,2339	3,1215	3,1180
2Y	2,9880	1	16	3,1585	3,1270	3,1530
3Y	3,0470	1	18	3,1380	3,1300	3,1690
4Y	3,0650	1	19	3,1180	3,1380	3,2125
5Y	3,0710	1	20	3,1238	3,1530	3,2309
7Y	3,0880	1	21	3,1680	3,1810	3,1880
10Y	3,1240	1	21	3,1980	3,2110	3,2410
15Y	3,1620	2	21	3,1630	3,2468	3,2395
20Y	3,1680	2	20	3,2200	3,1725	3,2110
30Y	3,1380	2	20	3,2014	3,1715	3,1835



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	85,30	0,50	7,40	OT 2Y	-0,091	-0,01	3,00
JETFUEL	791,64	2,29	55,99	OT 5Y	0,740	-0,02	4,50
DIESEL	747,39	1,54	44,49	OT 10Y	1,893	-0,01	-1,30
COBRE	6.253,50	31,00	305,00	BUND 10Y	0,091	5,52	14,50
ZINCO	2.688,00	-3,50	226,50	SCHATZ 2Y	0,092	2,53	7,10
OURO	1.199,29	-4,70	-2,08	T-NOTE 10Y	3,778	4,94	20,60
TRIGO	521,75	2,50	-23,75	T-NOTE 2Y	3,239	3,93	18,80
LICENÇA C02	21,18	0,20	1,01	GILT 10Y	1,713	3,71	16,00


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1548	0,04%	-0,53%	1,1642	1,1731	1,1935
EUR/GBP	0,88895	0,17%	1,42%	0,8920	0,8950	0,9017
EUR/JPY	131,47	-0,01%	-1,86%	131,47	131,47	131,47
EUR/CHF	1,1402	-0,19%	-1,24%	1,1389	1,1378	1,1355
EUR/BRL	4,4667	1,86%	8,17%	4,5404	4,6183	4,8004
EUR/PLN	4,2979	-0,09%	-0,13%	4,3219	4,3445	4,3946

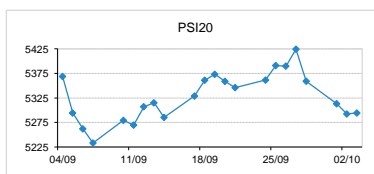

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1548	0,8890	131,47	1,1402	10,4088	7,4561	1,4775	1,61477	4,4667	9,4531
USD	0,8666	-	0,7689	114,085	0,9889	9,0134	6,4617	1,2821	1,3981	3,8498	8,1815

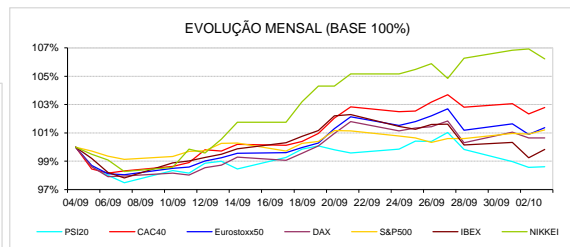
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	8,190	-0,61	58,38
BCP	0,245	0,33	-9,82
CORT. AMORIM	11,400	-0,52	10,68
CTT	3,326	-0,12	-5,16
EDP	3,201	1,62	10,95
EDP R	8,770	1,74	25,88
GALP	16,955	0,06	10,64
IBERSOL	9,100	0,00	-10,12
J MARTINS	11,830	-3,59	-26,95
MOTA ENGIL	2,025	1,86	-44,72
NAVIGATOR	4,328	-1,68	2,56
NOS	5,130	1,18	-6,40
NOVABASE	2,650	-0,38	-13,09
PHAROL	0,163	-2,74	-34,72
REN	2,392	0,17	-3,51
SEMAPA	17,620	0,46	-0,98
SONAE CAP.	0,710	1,43	-19,95
SONAE SGPS	0,890	0,11	-21,00

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	1,86
EDP R	1,74
EDP	1,62
SONAE CAP.	1,43
NOS	1,18
CORT. AMORIM	-0,52
ALTRI	-0,61
NAVIGATOR	-1,68
PHAROL	-2,74
J MARTINS	-3,59



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.294,32	0,04%	-1,74%	5.801,45	5.208,33
CAC40	5.491,40	0,43%	3,37%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.405,48	0,49%	-2,81%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.287,58	-0,42%	-4,88%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.931,88	0,29%	9,66%	2.940,91	2.528,85
IBEX 35	9.361,10	0,60%	-6,80%	10.643,40	9.111,10
NIKKEI 225	24.110,96	-0,66%	5,91%	24.448,07	20.347,49



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.