

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

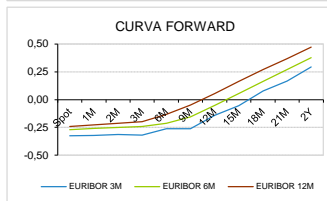
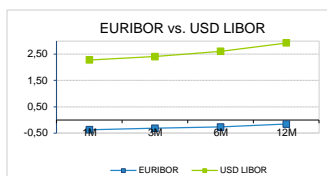
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

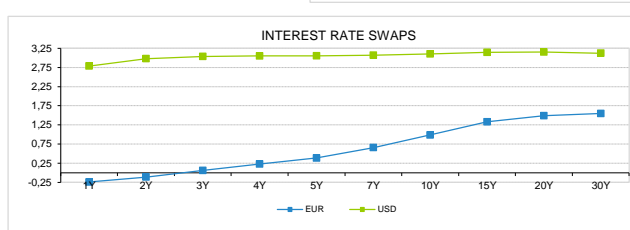
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	2,2793	1	17	0,7183	-0,7840
3M	-0,3180	0	0	3M	2,4083	0	9	0,7968	-0,7384
6M	-0,2680	0	0	6M	2,6089	0	7	0,8956	-0,6596
12M	-0,1590	0	1	12M	2,9273	0	9	1,0621	-0,5334

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2415	0	1	0,0549	0,8190	1,3340
2Y	-0,1110	0	4	0,2637	0,9555	1,4340
3Y	0,0600	1	7	0,4485	1,0810	1,5260
4Y	0,2280	1	9	0,6080	1,1930	1,6110
5Y	0,3840	1	11	0,7505	1,2940	1,6890
7Y	0,6570	1	12	0,9930	1,4710	1,7762
10Y	0,9860	1	12	1,2740	1,6516	1,9000
15Y	1,3310	1	10	1,5385	1,7933	1,9510
20Y	1,4880	1	9	1,6438	1,8221	1,9200
30Y	1,5480	1	8	1,6566	1,7710	1,8310

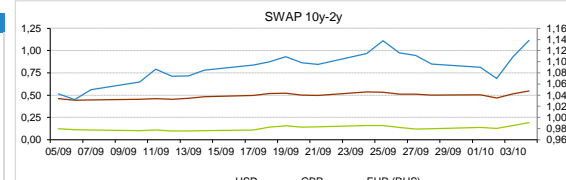
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



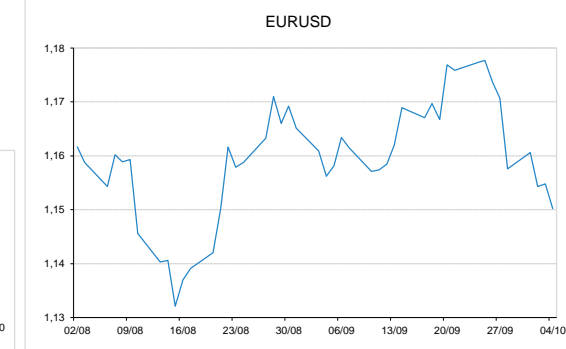
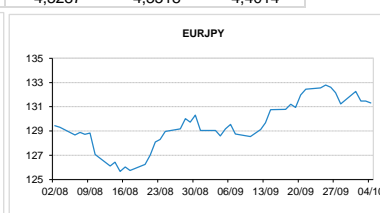
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7850	0	12	3,2901	3,2010	3,2135
2Y	2,9790	-1	15	3,2510	3,2125	3,2560
3Y	3,0350	-1	17	3,2370	3,2200	3,2720
4Y	3,0490	-2	18	3,2420	3,2100	3,2910
5Y	3,0530	-2	18	3,2410	3,2490	3,3356
7Y	3,0680	-2	19	3,2540	3,2810	3,3280
10Y	3,1030	-2	19	3,2875	3,2800	3,3639
15Y	3,1440	-2	19	3,2855	3,2960	3,3280
20Y	3,1500	-2	19	3,2805	3,3238	3,3030
30Y	3,1220	-2	18	3,2871	3,2295	3,2225



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	85,57	-0,72	7,67	OT 2Y	-0,098	-0,01	2,00
JETFUEL	791,64	2,29	55,99	OT 5Y	0,758	0,02	8,90
DIESEL	747,39	1,54	44,49	OT 10Y	1,915	0,02	4,50
COBRE	6.332,00	-13,00	300,00	BUND 10Y	0,152	7,15	17,80
ZINCO	2.681,00	-7,00	212,50	SCHATZ 2Y	0,113	2,30	7,40
OURO	1.201,30	2,59	7,94	T-NOTE 10Y	3,835	3,08	22,60
TRIGO	517,75	2,50	-13,75	T-NOTE 2Y	3,275	2,36	19,70
LICENÇA C02	21,35	0,17	1,17	GILT 10Y	1,796	9,82	22,40


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1502	-0,40%	-0,52%	1,1594	1,1685	1,1888
EUR/GBP	0,8858	0,36%	1,67%	0,8888	0,8918	0,8986
EUR/JPY	131,31	0,12%	-2,06%	131,31	131,31	131,31
EUR/CHF	1,1416	-0,20%	-1,17%	1,1404	1,1392	1,1370
EUR/BRL	4,514	-0,76%	6,74%	4,5894	4,6708	4,8603
EUR/PLN	4,3053	-0,10%	0,06%	4,3287	4,3518	4,4014

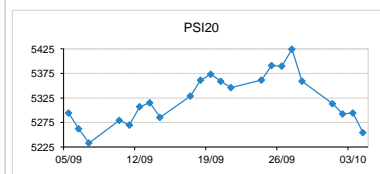

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1502	0,8858	131,31	1,1416	10,4121	7,4569	1,4845	1,62608	4,5140	9,4789
USD	0,8679	-	0,7677	113,685	0,9910	9,0440	6,4723	1,2876	1,4105	3,9125	8,2251

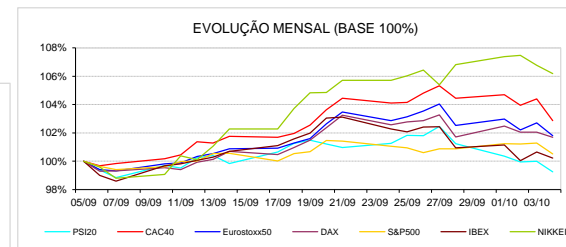
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	8,610	5,13	66,51
BCP	0,240	-2,20	-11,80
CORT. AMORIM	11,320	-0,70	9,90
CTT	3,330	0,12	-5,05
EDP	3,185	-0,50	10,40
EDP R	8,590	-2,05	23,30
GALP	16,950	-0,03	10,60
IBERSOL	9,100	0,00	-10,12
J MARTINS	11,750	-0,68	-27,45
MOTA ENGIL	1,994	-1,53	-45,56
NAVIGATOR	4,298	-0,69	1,85
NOS	5,085	-0,88	-7,22
NOVABASE	2,650	0,00	-13,09
PHAROL	0,156	-4,41	-37,60
REN	2,388	-0,17	-3,67
SEMAPA	17,440	-1,02	-1,99
SONAE CAP.	0,696	-1,97	-21,53
SONAE SGPS	0,868	-2,47	-22,96

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	5,13
CTT	0,12
SONAE CAP.	-1,97
EDP R	-2,05
BCP	-2,20
SONAE SGPS	-2,47
PHAROL	-4,41



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.254,19	-0,76%	-2,49%	5.801,45	5.208,33
CAC40	5.410,85	-1,47%	1,85%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.375,38	-0,88%	-3,67%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.244,14	-0,35%	-5,21%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.903,57	-0,75%	8,60%	2.940,91	2.531,80
IBEX 35	9.322,40	-0,41%	-7,18%	10.643,40	9.111,10
NIKKEI 225	23.975,62	-0,56%	5,32%	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.