

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

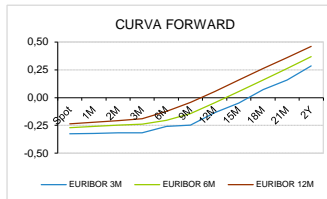
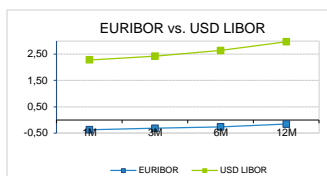
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

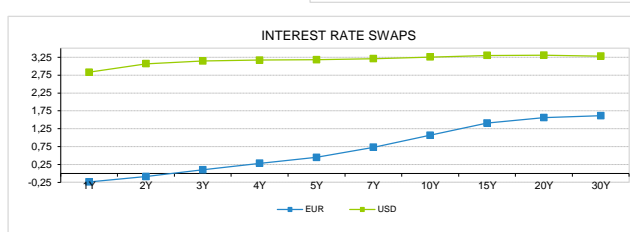
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,2832	0	14	0,7200	-0,7838
3M	-0,3180	0	0	3M	2,4252	0	9	0,8045	-0,7424
6M	-0,2670	0	0	6M	2,6363	1	8	0,9059	-0,6598
12M	-0,1560	0	1	12M	2,9691	1	11	1,0936	-0,5276

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2364	0	2	0,0466	0,8215	1,3430
2Y	-0,0890	0	6	0,2547	0,9659	1,4480
3Y	0,0990	0	10	0,4440	1,0911	1,5400
4Y	0,2830	-1	13	0,6086	1,2035	1,6260
5Y	0,4480	-1	14	0,7536	1,3055	1,7040
7Y	0,7320	-1	15	1,0005	1,4825	1,8150
10Y	1,0660	-1	14	1,2840	1,6632	1,9190
15Y	1,4070	-1	12	1,5474	1,8053	1,9772
20Y	1,5600	-2	11	1,6571	1,8366	1,9415
30Y	1,6120	-2	9	1,6695	1,7855	1,8455

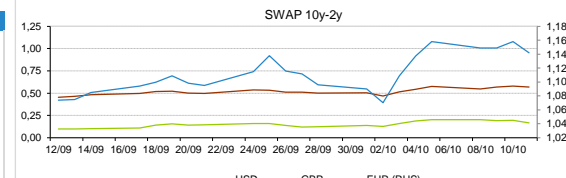
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



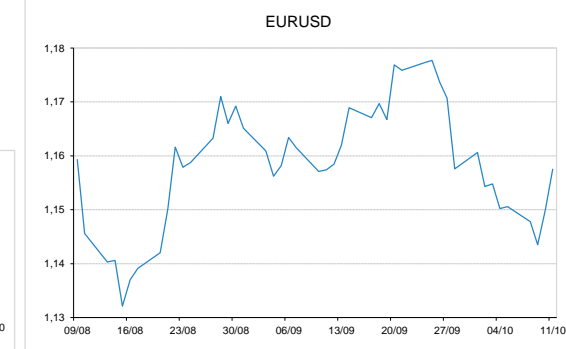
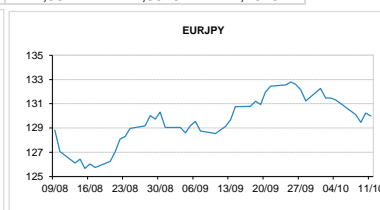
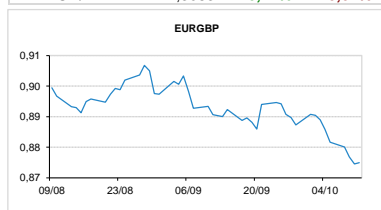
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8280	1	12	3,2730	3,1760	3,1860
2Y	3,0680	0	18	3,2400	3,1615	3,2070
3Y	3,1440	0	21	3,2365	3,1961	3,2532
4Y	3,1680	-1	22	3,2222	3,2101	3,2744
5Y	3,1800	-1	23	3,2211	3,2000	3,2948
7Y	3,2100	-1	24	3,2120	3,2591	3,3194
10Y	3,2560	-1	25	3,2480	3,2930	3,3070
15Y	3,3000	0	25	3,2963	3,2820	3,3226
20Y	3,3070	0	25	3,2710	3,2670	3,2720
30Y	3,2780	0	25	3,2340	3,2477	3,2210



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	80,96	-2,13	2,40	OT 2Y	-0,099	0,00	1,60
JETFUEL	767,25	-18,46	29,58	OT 5Y	0,838	0,04	15,40
DIESEL	726,00	-17,21	26,58	OT 10Y	2,021	0,06	12,70
COBRE	6.218,00	-53,00	329,00	BUND 10Y	0,126	-3,51	7,30
ZINCO	2.636,50	-83,50	253,00	SCHATZ 2Y	0,087	-1,61	0,00
OURO	1.219,73	29,61	24,12	T-NOTE 10Y	3,797	-4,80	12,40
TRIGO	508,50	-2,00	-10,25	T-NOTE 2Y	3,235	-2,75	7,00
LICENÇA C02	19,82	0,36	-4,36	GILT 10Y	1,797	-4,85	15,80


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1575	0,65%	0,01%	1,1669	1,1762	1,1964
EUR/GBP	0,8749	-0,05%	1,80%	0,8779	0,8810	0,8878
EUR/JPY	130	0,18%	-0,91%	130,00	130,00	130,00
EUR/CHF	1,1475	-0,37%	-1,67%	1,1463	1,1452	1,1429
EUR/BRL	4,3452	-0,38%	10,93%	4,4158	4,4897	4,6584
EUR/PLN	4,3083	0,14%	-0,04%	4,3321	4,3549	4,4046

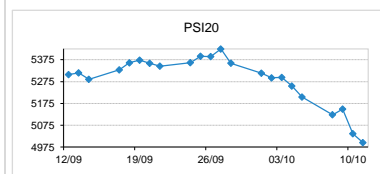

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1575	0,8749	130,00	1,1475	10,4292	7,4608	1,5081	1,62621	4,3452	9,5146
USD	0,8648	-	0,7567	112,275	0,9898	9,0062	6,4516	1,3051	1,4066	3,7537	8,2184

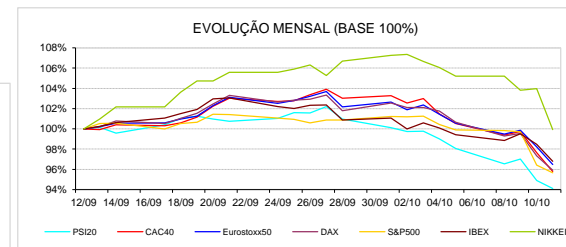
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,460	-4,60	44,27
BCP	0,227	0,04	-16,65
CORT. AMORIM	10,340	-1,15	0,39
CTT	3,122	-2,13	-10,98
EDP	3,080	-1,91	6,76
EDP R	8,090	-2,53	16,12
GALP	15,850	-3,97	3,43
IBERSOL	9,020	-0,22	-10,91
J MARTINS	11,285	0,76	-30,32
MOTA ENGIL	1,776	-0,78	-51,52
NAVIGATOR	4,160	6,67	-1,42
NOS	4,878	-0,08	-11,00
NOVABASE	2,620	-0,76	-14,07
PHAROL	0,146	-2,14	-41,44
REN	2,350	-0,42	-5,20
SEMAPA	17,040	6,10	-4,24
SONAE CAP.	0,720	-6,01	-18,83
SONAE SGPS	0,829	-2,64	-26,38

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NAVIGATOR	6,67
SEMAPA	6,10
J MARTINS	0,76
BCP	0,04
EDP R	-2,53
SONAE SGPS	-2,64
GALP	-3,97
ALTRI	-4,60
SONAE CAP.	-6,01



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.994,35	-0,82%	-7,31%	5.801,45	4.962,72
CAC40	5.106,37	-1,92%	-3,88%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.209,19	-1,77%	-8,41%	3.708,82	3.206,20
XTRA DAX	11.539,35	-1,48%	-10,67%	13.596,89	11.518,56
S&P 500	2.764,28	-0,80%	3,36%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	9.007,90	-1,69%	-10,31%	10.643,40	8.971,30
NIKKEI 225	22.590,86	-3,89%	-0,76%	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.