

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

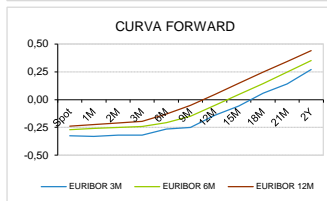
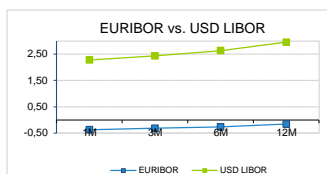
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

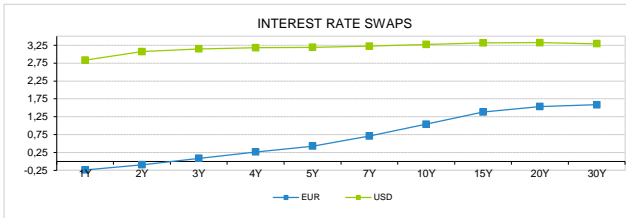
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,2795	0	13	0,7215	-0,7854
3M	-0,3180	0	0	3M	2,4363	1	10	0,8084	-0,7424
6M	-0,2670	0	0	6M	2,6353	0	8	0,9006	-0,6598
12M	-0,1570	0	1	12M	2,9543	-1	9	1,0899	-0,5270

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2380	0	2	0,0445	0,8011	1,3345
2Y	-0,0920	0	5	0,2436	0,9405	1,4385
3Y	0,0890	-1	9	0,4274	1,0705	1,5343
4Y	0,2670	-2	10	0,5890	1,1870	1,6199
5Y	0,4280	-2	11	0,7355	1,2910	1,6905
7Y	0,7090	-2	12	0,9845	1,4690	1,8050
10Y	1,0400	-3	11	1,2691	1,6527	1,9100
15Y	1,3810	-3	9	1,5383	1,7981	1,9620
20Y	1,5330	-3	8	1,6463	1,8264	1,9284
30Y	1,5850	-3	6	1,6587	1,7768	1,8390

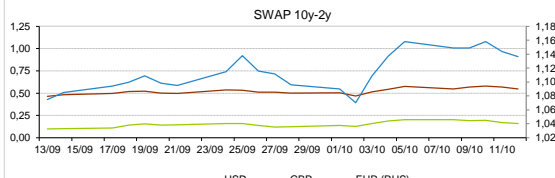
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



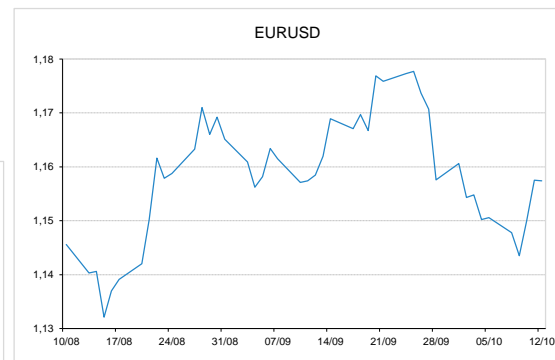
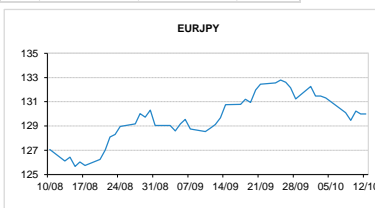
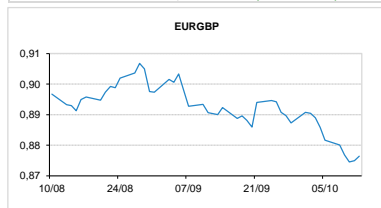
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8320	0	11	3,2513	3,1817	3,1750
2Y	3,0710	0	18	3,2220	3,1752	3,1910
3Y	3,1490	1	21	3,2218	3,1812	3,2055
4Y	3,1770	1	23	3,2086	3,1930	3,2240
5Y	3,1910	1	24	3,1943	3,1840	3,2723
7Y	3,2220	1	26	3,2167	3,2160	3,2710
10Y	3,2700	1	27	3,2300	3,2745	3,2860
15Y	3,3140	1	28	3,2560	3,2630	3,3027
20Y	3,3210	1	27	3,2520	3,2480	3,2530
30Y	3,2920	1	27	3,2140	3,2060	3,2000



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	80,29	0,03	1,00	OT 2Y	-0,094	0,01	2,10
JETFUEL	764,25	-3,00	29,25	OT 5Y	0,865	0,03	19,80
DIESEL	722,25	-3,75	25,50	OT 10Y	2,041	0,02	17,90
COBRE	6.273,50	3,00	383,00	BUND 10Y	0,108	-1,67	8,00
ZINCO	2.634,00	-2,50	321,00	SCHATZ 2Y	0,071	-1,61	-0,70
OURO	1.219,16	-0,68	15,06	T-NOTE 10Y	3,790	1,54	12,90
TRIGO	516,50	8,50	9,75	T-NOTE 2Y	3,235	1,18	7,40
LICENÇA C02	20,42	0,55	-2,53	GILT 10Y	1,758	-4,34	13,70


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1574	-0,01%	-0,10%	1,1670	1,1762	1,1965
EUR/GBP	0,8764	-0,17%	1,58%	0,8795	0,8826	0,8893
EUR/JPY	129,99	0,01%	-0,66%	129,99	129,99	129,99
EUR/CHF	1,1460	0,16%	-1,53%	1,1448	1,1437	1,1413
EUR/BRL	4,3833	-1,26%	9,95%	4,4538	4,5265	4,6986
EUR/PLN	4,3003	0,17%	0,27%	4,3241	4,3474	4,3968

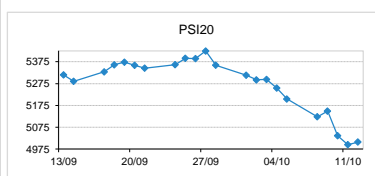

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1574	0,8764	129,99	1,1460	10,3639	7,4604	1,5057	1,62446	4,3833	9,4501
USD	0,8649	-	0,7601	112,115	0,9921	8,9711	6,4525	1,3026	1,4052	3,7792	8,1759

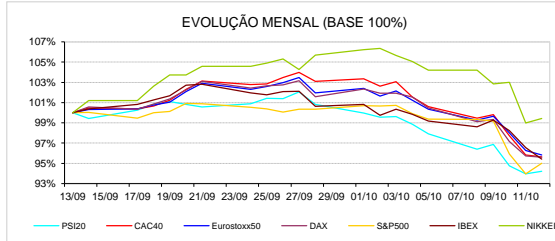
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,730	3,62	49,49
BCP	0,228	0,49	-16,25
CORT. AMORIM	10,380	0,39	0,78
CTT	3,110	-0,38	-11,32
EDP	3,053	-0,88	5,82
EDP R	8,130	0,49	16,69
GALP	15,650	-1,26	2,12
IBERSOL	9,000	-0,22	-11,11
J MARTINS	11,465	1,60	-29,21
MOTA ENGIL	1,830	3,04	-50,04
NAVIGATOR	4,100	-1,44	-2,85
NOS	4,900	0,45	-10,60
NOVABASE	2,400	-8,40	-21,29
PHAROL	0,152	3,83	-39,20
REN	2,334	-0,68	-5,85
SEMAPA	16,840	-1,17	-5,37
SONAE CAP.	0,742	3,06	-16,35
SONAE SGPS	0,872	5,19	-22,56

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE SGPS	5,19
PHAROL	3,83
ALTRI	3,62
SONAE CAP.	3,06
MOTA ENGIL	3,04
EDP	-0,88
SEMAPA	-1,17
GALP	-1,26
NAVIGATOR	-1,44
NOVABASE	-8,40



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.006,81	0,25%	-7,08%	5.801,45	4.962,72
CAC40	5.095,98	-0,20%	-4,08%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.194,41	-0,46%	-8,83%	3.708,82	3.193,40
XTRA DAX	11.523,81	-0,13%	-10,79%	13.596,89	11.514,55
S&P 500	2.759,37	1,12%	3,19%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.902,00	-1,18%	-11,37%	10.643,40	8.897,80
NIKKEI 225	22.694,66	0,46%	-0,31%	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.