

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

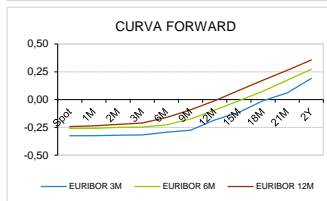
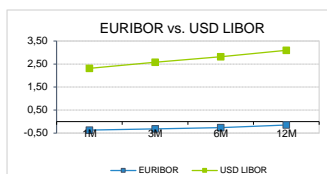
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

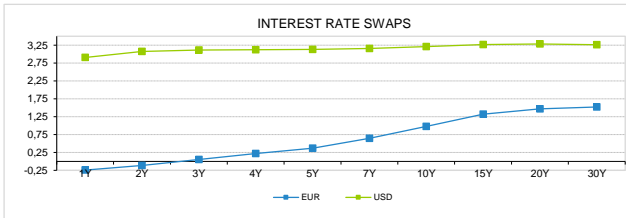
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,3136	1	5	0,7259	-0,7854
3M	-0,3180	0	0	3M	2,5815	2	18	0,8259	-0,7460
6M	-0,2580	0	1	6M	2,8165	2	21	0,9460	-0,6644
12M	-0,1480	0	1	12M	3,0961	1	17	1,0873	-0,5322

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2427	0	0	-0,0120	0,7110	1,2507
2Y	-0,1130	1	-1	0,1739	0,8549	1,3600
3Y	0,0530	2	-2	0,3511	0,9859	1,4590
4Y	0,2180	2	-3	0,5100	1,1062	1,5460
5Y	0,3710	2	-3	0,6566	1,2145	1,6260
7Y	0,6470	2	-3	0,9102	1,3975	1,7430
10Y	0,9780	2	-3	1,2009	1,5878	1,8505
15Y	1,3190	2	-3	1,4758	1,7363	1,9025
20Y	1,4710	1	-3	1,5846	1,7644	1,8685
30Y	1,5220	1	-4	1,5962	1,7127	1,7755

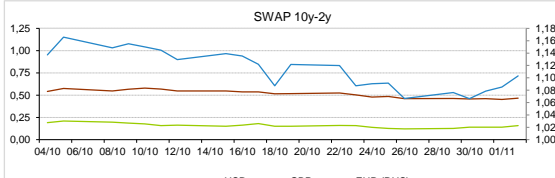
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,9060	3	12	3,2488	3,1932	3,2040
2Y	3,0750	4	9	3,2393	3,1963	3,2320
3Y	3,1160	4	8	3,1935	3,1930	3,3102
4Y	3,1250	4	7	3,1840	3,1900	3,3120
5Y	3,1310	4	7	3,1880	3,2385	3,3619
7Y	3,1560	4	8	3,2542	3,2610	3,3958
10Y	3,2090	4	10	3,3106	3,3589	3,4158
15Y	3,2680	4	12	3,3095	3,3824	3,3840
20Y	3,2830	3	13	3,3115	3,3759	3,3620
30Y	3,2650	3	14	3,2996	3,3354	3,3395

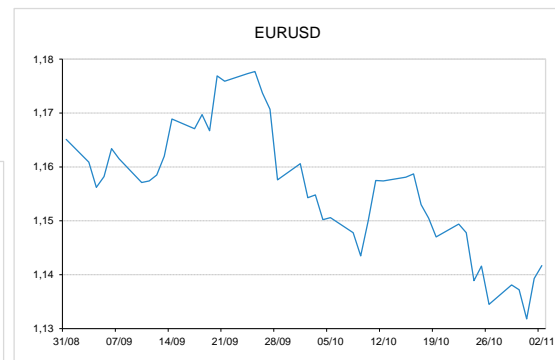
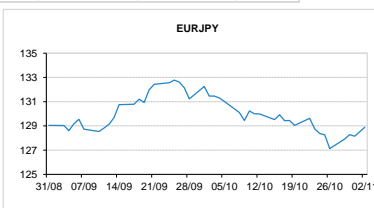
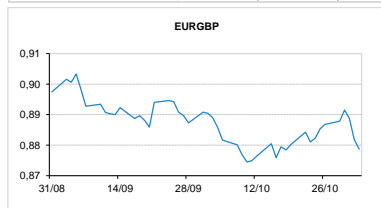


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	72,80	-0,09	-11,55	OT 2Y	-0,137	0,00	-4,80
JETFUEL	716,54	-6,44	-72,81	OT 5Y	0,692	-0,01	-4,90
DIESEL	675,54	-7,19	-70,31	OT 10Y	1,882	0,00	-1,20
COBRE	6.139,00	98,00	-159,00	BUND 10Y	0,025	2,33	-5,60
ZINCO	2.592,75	46,00	-95,25	SCHATZ 2Y	0,016	0,23	-7,40
OURO	1.231,66	-1,80	28,32	T-NOTE 10Y	3,799	4,44	-0,50
TRIGO	509,25	1,25	-10,00	T-NOTE 2Y	3,247	3,93	-0,40
LICENÇA C02	17,14	1,52	-3,84	GILT 10Y	1,626	3,97	-7,20



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1417	0,21%	-1,09%	1,1513	1,1603	1,1807
EUR/GBP	0,8787	0,34%	1,33%	0,8819	0,8851	0,8921
EUR/JPY	128,89	-0,29%	1,99%	128,89	128,89	128,89
EUR/CHF	1,1417	0,15%	-0,47%	1,1405	1,1394	1,1371
EUR/BRL	4,2235	-0,24%	10,20%	4,2885	4,3510	4,5076
EUR/PLN	4,3204	0,16%	-0,58%	4,3448	4,3678	4,4181



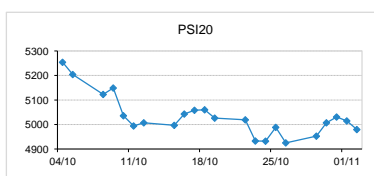
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1417	0,8787	128,89	1,1417	10,3174	7,4601	1,4929	1,58306	4,2235	9,5258
USD	0,8755	-	0,77	112,945	1,0009	9,0336	6,5312	1,3104	1,3867	3,7010	8,3391

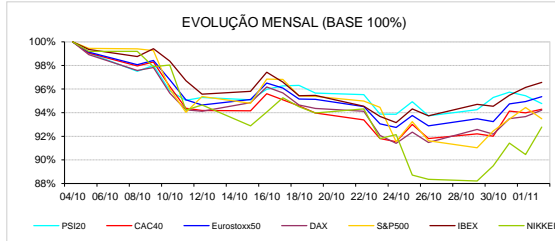
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,450	-2,74	44,07
BCP	0,243	1,21	-10,74
CORT. AMORIM	9,750	0,52	-5,34
CTT	3,344	-1,94	-4,65
EDP	3,080	-1,16	6,76
EDP R	7,850	-1,26	12,67
GALP	14,830	-1,03	-3,23
IBERSOL	8,480	0,00	-16,25
J MARTINS	10,825	-1,55	-33,16
MOTA ENGIL	1,780	1,60	-51,41
NAVIGATOR	4,170	-0,95	-1,19
NOS	5,040	-0,40	-8,05
NOVABASE	2,480	0,00	-18,66
PHAROL	0,153	0,13	-38,80
REN	2,370	0,77	-4,40
SEMAPA	15,960	-3,27	-10,31
SONAE CAP.	0,761	-0,26	-14,21
SONAE SGPS	0,890	0,11	-20,96

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	1,60
BCP	1,21
REN	0,77
CORT. AMORIM	0,52
PHAROL	0,13
EDP R	-1,26
J MARTINS	-1,55
CTT	-1,94
ALTRI	-2,74
SEMAPA	-3,27



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.979,51	-0,70%	-7,59%	5.801,45	4.893,44
CAC40	5.102,13	0,32%	-3,96%	5.657,44	4.896,80
ESTX 50 PR	3.218,35	0,44%	-8,15%	3.698,56	3.090,85
XTRA DAX	11.535,40	0,58%	-10,70%	13.596,89	11.051,04
S&P 500	2.712,65	-1,01%	1,46%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.994,70	0,45%	-10,45%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	22.243,66	2,56%	-2,29%	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.