

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

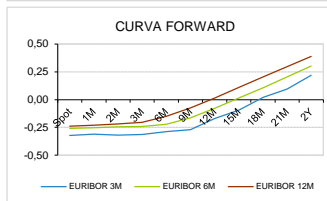
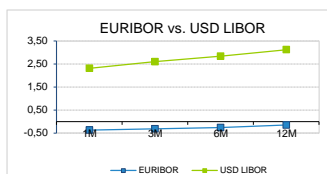
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

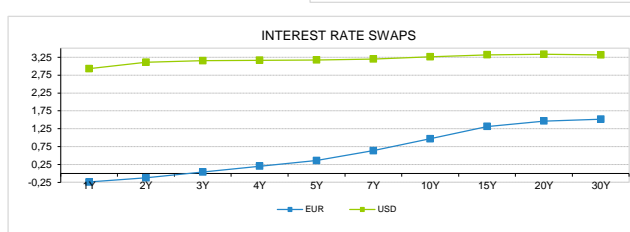
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,3153	0	4	0,7269	-0,7862
3M	-0,3160	0	0	3M	2,6011	1	19	0,8546	-0,7478
6M	-0,2570	0	1	6M	2,8435	0	22	0,9809	-0,6660
12M	-0,1480	0	1	12M	3,1251	1	17	1,1373	-0,5318

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2398	0	0	0,0141	0,7330	1,2755
2Y	-0,1230	1	-3	0,2017	0,8775	1,3908
3Y	0,0380	1	-6	0,3789	1,0090	1,4850
4Y	0,2040	1	-8	0,5375	1,1319	1,5720
5Y	0,3600	1	-9	0,6825	1,2376	1,6455
7Y	0,6370	0	-10	0,9345	1,4200	1,7640
10Y	0,9700	0	-9	1,2241	1,6065	1,8700
15Y	1,3150	0	-8	1,4952	1,7540	1,9200
20Y	1,4670	0	-8	1,6031	1,7810	1,8848
30Y	1,5160	0	-8	1,6129	1,7276	1,7880

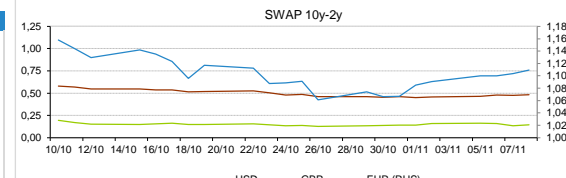
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



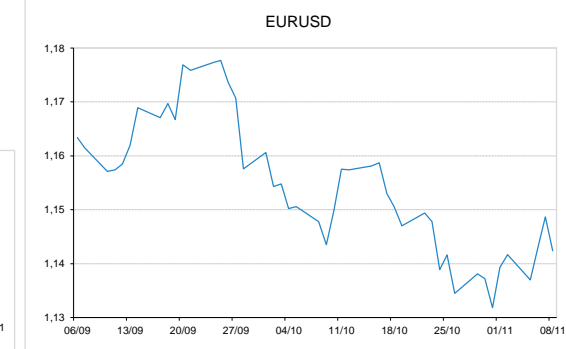
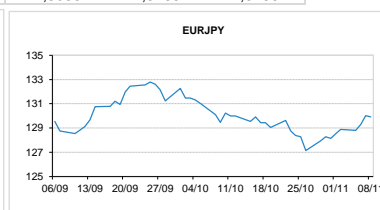
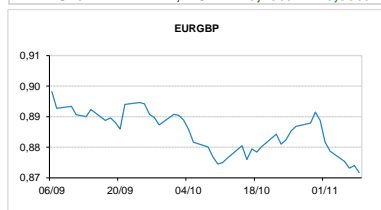
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,9310	1	12	3,3000	3,2275	3,2480
2Y	3,1080	1	4	3,2640	3,2250	3,2540
3Y	3,1540	1	1	3,2390	3,2399	3,2725
4Y	3,1660	1	-1	3,2265	3,2613	3,3240
5Y	3,1740	1	-1	3,2275	3,2340	3,3779
7Y	3,2030	1	-1	3,2440	3,3060	3,3850
10Y	3,2610	0	0	3,3160	3,3250	3,3755
15Y	3,3190	0	2	3,3290	3,3933	3,3725
20Y	3,3330	0	2	3,3765	3,3360	3,3480
30Y	3,3130	-1	3	3,3230	3,2980	3,2970



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	71,39	-0,68	-12,15	OT 2Y	-0,156	0,00	-5,40
JETFUEL	712,65	-13,72	-70,68	OT 5Y	0,740	0,01	-6,00
DIESEL	672,65	-14,47	-67,43	OT 10Y	1,940	0,01	-3,50
COBRE	6.155,00	-5,00	-20,00	BUND 10Y	0,048	1,06	-9,70
ZINCO	2.507,50	-39,50	-165,50	SCHATZ 2Y	0,044	0,23	-5,20
OURO	1.223,94	-4,70	37,47	T-NOTE 10Y	3,833	1,37	-0,50
TRIGO	510,75	0,50	-3,25	T-NOTE 2Y	3,302	0,79	3,10
LICENÇA C02	19,52	0,90	-2,42	GILT 10Y	1,687	2,83	-12,30


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1424	-0,55%	-0,47%	1,1522	1,1615	1,1821
EUR/GBP	0,87163	0,28%	0,97%	0,8748	0,8780	0,8851
EUR/JPY	129,9	0,09%	0,16%	129,90	129,90	129,90
EUR/CHF	1,1453	0,04%	-0,45%	1,1441	1,1430	1,1407
EUR/BRL	4,2842	-0,08%	1,39%	4,3488	4,4122	4,5669
EUR/PLN	4,2782	0,23%	0,99%	4,3033	4,3263	4,3759

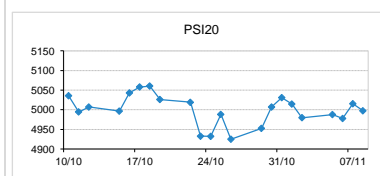

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1424	0,8716	129,90	1,1453	10,2559	7,4586	1,4970	1,5667	4,2842	9,5319
USD	0,8749	-	0,7618	113,785	1,0026	8,9692	6,5265	1,3106	1,3716	3,7485	8,3357

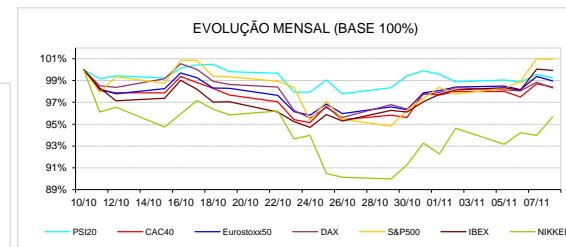
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,470	0,40	44,46
BCP	0,248	-0,36	-8,97
CORT. AMORIM	9,910	1,43	-3,79
CTT	3,392	-0,18	-3,28
EDP	3,178	2,19	10,16
EDP R	7,795	-0,76	11,88
GALP	14,955	-0,30	-2,41
IBERSOL	8,420	-0,47	-16,84
J MARTINS	10,805	-0,09	-33,28
MOTA ENGIL	1,746	-1,91	-52,33
NAVIGATOR	4,126	-0,39	-2,23
NOS	5,155	-0,67	-5,95
NOVABASE	2,440	-3,56	-19,97
PHAROL	0,166	0,61	-33,60
REN	2,420	1,34	-2,38
SEMAPA	15,800	-0,38	-11,21
SONAE CAP.	0,758	1,34	-14,54
SONAE SGPS	0,859	-0,58	-23,71

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP	2,19
CORT. AMORIM	1,43
REN	1,34
SONAE CAP.	1,34
PHAROL	0,61
SONAE SGPS	-0,58
NOS	-0,67
EDP R	-0,76
MOTA ENGIL	-1,91
NOVABASE	-3,56



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.015,29	-0,36%	-7,26%	5.801,45	4.893,44
CAC40	5.127,80	-0,28%	-3,56%	5.657,44	4.896,80
ESTX 50 PR	3.235,38	-0,41%	-7,74%	3.687,22	3.090,85
XTRA DAX	11.525,21	-0,54%	-10,84%	13.596,89	11.051,04
S&P 500	2.811,79	-0,07%	5,17%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	9.157,70	-0,11%	-8,82%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	22.486,92	1,82%	-1,22%	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.