

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

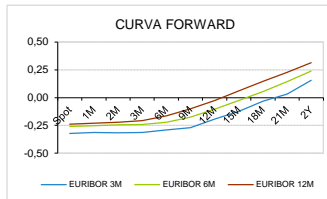
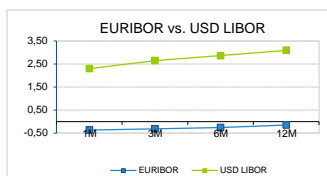
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

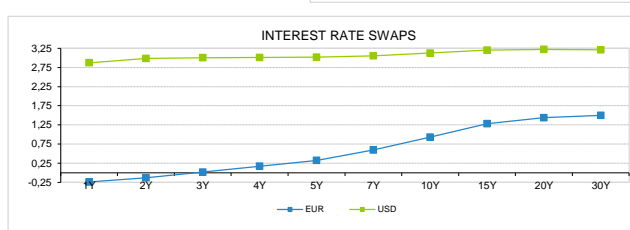
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,3055	1	2	0,7338	-0,7864
3M	-0,3160	0	0	3M	2,6531	1	18	0,8894	-0,7448
6M	-0,2570	0	1	6M	2,8633	0	14	0,9988	-0,6694
12M	-0,1480	0	1	12M	3,0971	-1	8	1,1334	-0,5318

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2400	0	0	-0,0269	0,6375	1,1845
2Y	-0,1320	-1	-1	0,1450	0,7800	1,2955
3Y	0,0180	-1	-3	0,3090	0,9130	1,3960
4Y	0,1730	-1	-4	0,4620	1,0350	1,4875
5Y	0,3210	-1	-5	0,6039	1,1465	1,5650
7Y	0,5950	-2	-5	0,8565	1,3355	1,6959
10Y	0,9270	-2	-5	1,1521	1,5303	1,8106
15Y	1,2800	-2	-5	1,4277	1,6852	1,8694
20Y	1,4380	-2	-5	1,5442	1,7228	1,8376
30Y	1,4960	-2	-5	1,5636	1,6795	1,7463

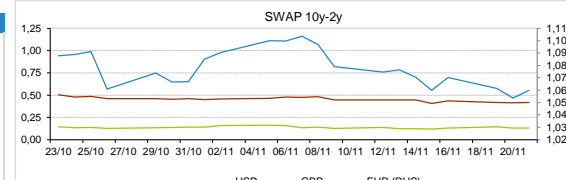
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



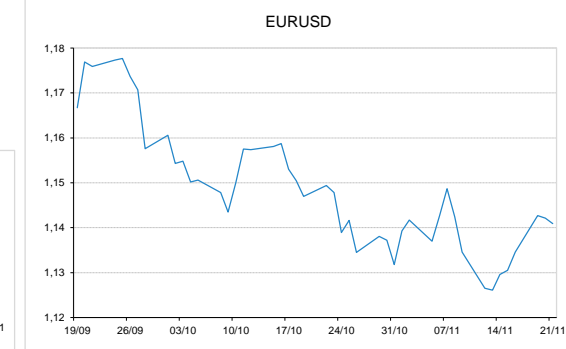
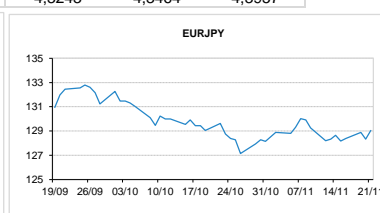
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8730	-3	-2	3,1124	3,0400	3,1175
2Y	2,9830	-4	-12	3,0822	3,0742	3,1310
3Y	3,0030	-4	-17	3,0470	3,0760	3,1989
4Y	3,0080	-4	-18	3,0690	3,0930	3,1980
5Y	3,0160	-4	-18	3,0605	3,1220	3,2586
7Y	3,0530	-3	-16	3,0960	3,1680	3,2600
10Y	3,1240	-3	-14	3,1958	3,2130	3,2860
15Y	3,1990	-3	-11	3,2105	3,2500	3,2870
20Y	3,2210	-3	-10	3,2260	3,2430	3,3015
30Y	3,2100	-3	-8	3,1960	3,2446	3,2190



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,11	1,58	-15,15	OT 2Y	-0,157	0,00	-6,50
JETFUEL	658,16	-1,18	-105,84	OT 5Y	0,760	-0,03	-8,30
DIESEL	617,25	-0,43	-102,25	OT 10Y	1,965	-0,02	-4,80
COBRE	6.173,00	-75,00	-36,00	BUND 10Y	-0,042	2,47	-9,20
ZINCO	2.585,00	-49,00	-64,50	SCHATZ 2Y	0,011	1,15	-3,00
OURO	1.225,21	3,14	-2,23	T-NOTE 10Y	3,700	2,88	-11,80
TRIGO	506,00	-2,50	-28,25	T-NOTE 2Y	3,169	2,75	-11,00
LICENÇA C02	20,48	1,02	0,77	GILT 10Y	1,517	0,38	-13,50


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1409	-0,11%	-0,74%	1,1507	1,1596	1,1796
EUR/GBP	0,89108	-0,22%	-0,77%	0,8944	0,8974	0,9042
EUR/JPY	129,04	-0,54%	0,46%	129,04	129,04	129,04
EUR/CHF	1,1337	-0,15%	0,84%	1,1324	1,1313	1,1288
EUR/BRL	4,3021	-0,70%	-1,75%	4,3658	4,4267	4,5713
EUR/PLN	4,2987	0,17%	-0,14%	4,3243	4,3464	4,3957

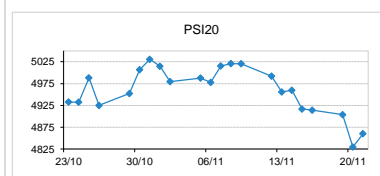

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1409	0,8911	129,04	1,1337	10,2864	7,4616	1,5118	1,56763	4,3021	9,7089
USD	0,8775	-	0,7824	112,975	0,9954	9,0498	6,5481	1,3294	1,3769	3,7925	8,5407

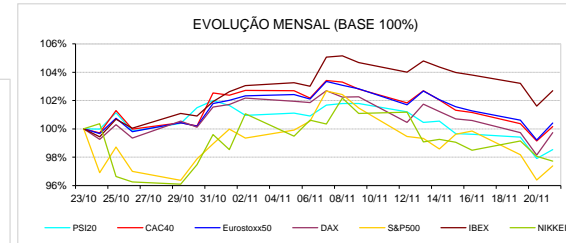
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	6,950	1,46	34,40
BCP	0,240	-0,41	-11,62
CORT. AMORIM	9,070	-0,44	-11,94
CTT	3,290	-0,42	-6,19
EDP	3,065	-0,49	6,24
EDP R	7,550	0,67	8,37
GALP	14,880	2,98	-2,90
IBERSOL	8,220	1,23	-18,81
J MARTINS	10,640	1,19	-34,30
MOTA ENGIL	1,544	2,25	-57,85
NAVIGATOR	3,838	0,26	-9,05
NOS	5,045	2,00	-7,95
NOVABASE	2,390	-0,42	-21,61
PHAROL	0,177	1,61	-29,20
REN	2,400	-0,33	-3,19
SEMAPA	14,340	-1,10	-19,42
SONAE CAP.	0,765	-0,65	-13,75
SONAE SGPS	0,826	-0,66	-26,69

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
GALP	2,98
MOTA ENGIL	2,25
NOS	2,00
PHAROL	1,61
ALTRI	1,46
CORT. AMORIM	-0,44
EDP	-0,49
SONAE CAP.	-0,65
SONAE SGPS	-0,66
SEMAPA	-1,10



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.859,96	0,63%	-9,81%	5.801,45	4.824,96
CAC40	4.975,50	1,03%	-6,34%	5.657,44	4.894,30
ESTX 50 PR	3.153,91	1,21%	-9,99%	3.687,22	3.090,85
XTRA DAX	11.244,17	1,61%	-12,95%	13.596,89	11.009,25
S&P 500	2.669,13	1,02%	-0,18%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.960,60	1,06%	-10,79%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	21.507,54	-0,35%	-5,52%	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.