

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

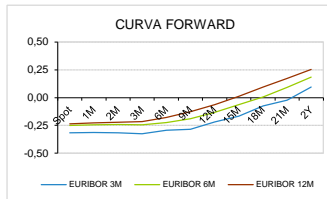
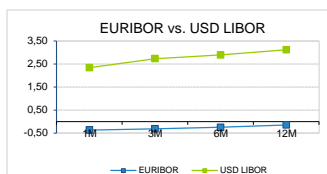
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

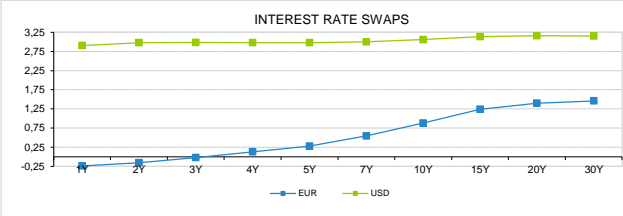
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,3469	0	5	0,7365	-0,8308
3M	-0,3160	0	0	3M	2,7361	0	20	0,8934	-0,7382
6M	-0,2480	0	1	6M	2,8946	1	10	1,0119	-0,6664
12M	-0,1430	0	1	12M	3,1203	0	5	1,1410	-0,5298

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2370	0	1	-0,0637	0,5778	1,1171
2Y	-0,1570	-1	-4	0,0940	0,7179	1,2332
3Y	-0,0210	-1	-6	0,2539	0,8498	1,3384
4Y	0,1300	-1	-7	0,4036	0,9736	1,4305
5Y	0,2760	-1	-8	0,5439	1,0861	1,5085
7Y	0,5450	-1	-8	0,7966	1,2788	1,6442
10Y	0,8810	-1	-7	1,0953	1,4782	1,7639
15Y	1,2390	-1	-6	1,3783	1,6377	1,8250
20Y	1,3980	-1	-6	1,4981	1,6791	1,7968
30Y	1,4600	-1	-5	1,5248	1,6431	1,7136

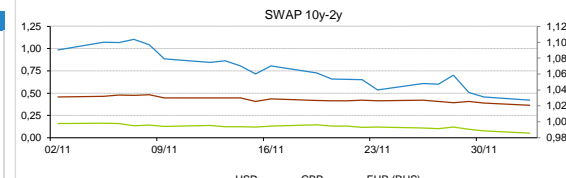
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,9060	1	3	3,0501	2,9160	2,8298
2Y	2,9790	1	-6	3,0040	2,9485	3,0031
3Y	2,9840	1	-9	2,9770	2,9405	3,0380
4Y	2,9790	1	-10	2,9650	2,9640	3,0710
5Y	2,9780	1	-11	2,9670	2,9905	3,1329
7Y	3,0000	0	-11	2,9970	3,0510	3,1590
10Y	3,0570	0	-11	3,0640	3,1190	3,1930
15Y	3,1330	0	-10	3,1480	3,1570	3,2030
20Y	3,1580	0	-9	3,1645	3,1841	3,1870
30Y	3,1510	0	-9	3,1270	3,1320	3,1420

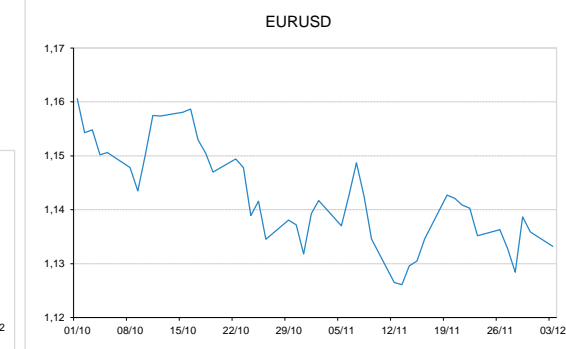
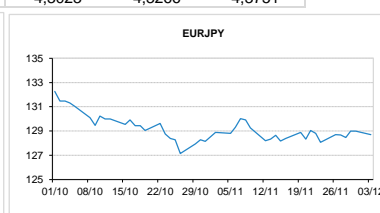


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	60,75	1,29	-12,08	OT 2Y	-0,236	-0,03	-10,10
JETFUEL	601,31	-3,85	-115,23	OT 5Y	0,576	-0,03	-12,40
DIESEL	561,81	-3,85	-113,73	OT 10Y	1,803	-0,02	-8,10
COBRE	6.198,50	-14,00	206,00	BUND 10Y	-0,115	0,00	-11,70
ZINCO	2.595,00	77,00	80,25	SCHATZ 2Y	-0,007	-0,46	-2,10
OURO	1.233,51	12,83	1,31	T-NOTE 10Y	3,648	-1,18	-13,40
TRIGO	521,75	6,00	-2,25	T-NOTE 2Y	3,145	0,00	-9,80
LICENÇA C02	20,66	0,16	3,58	GILT 10Y	1,513	-3,46	-15,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1332	-0,24%	-0,33%	1,1426	1,1521	1,1717
EUR/GBP	0,8915	-0,09%	-1,81%	0,8944	0,8976	0,9044
EUR/JPY	128,7	0,23%	0,09%	128,70	128,70	128,70
EUR/CHF	1,1329	-0,18%	1,07%	1,1316	1,1305	1,1282
EUR/BRL	4,3469	0,62%	-2,04%	4,4065	4,4749	4,6257
EUR/PLN	4,2778	0,32%	0,66%	4,3023	4,3266	4,3751



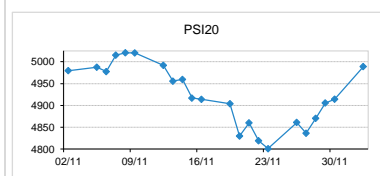
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1332	0,8915	128,70	1,1329	10,2521	7,4623	1,4982	1,5434	4,3469	9,7003
USD	0,8811	-	0,785	113,565	0,9979	9,0285	6,5751	1,3191	1,3591	3,8288	8,5381

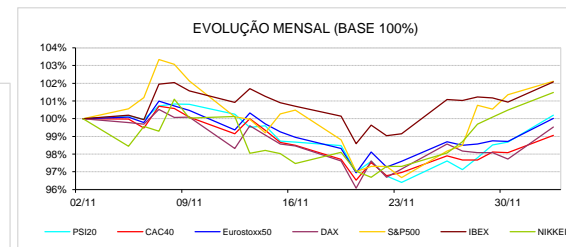
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	6,700	4,36	29,57
BCP	0,255	2,78	-6,25
CORT. AMORIM	9,490	1,50	-7,86
CTT	3,542	-1,17	1,00
EDP	3,111	0,78	7,83
EDP R	7,805	1,36	12,03
GALP	15,060	3,75	-1,73
IBERSOL	8,100	-0,25	-20,00
J MARTINS	10,585	0,43	-34,64
MOTA ENGIL	1,750	2,82	-52,22
NAVIGATOR	3,844	3,78	-8,91
NOS	5,485	0,00	0,07
NOVABASE	2,400	-0,83	-21,29
PHAROL	0,186	0,54	-25,60
REN	2,396	-0,50	-3,35
SEMAPA	14,300	2,44	-19,64
SONAE CAP.	0,809	1,51	-8,79
SONAE SGPS	0,837	0,00	-25,67

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	4,36
NAVIGATOR	3,78
GALP	3,75
MOTA ENGIL	2,82
BCP	2,78
IBERSOL	-0,25
REN	-0,50
NOVABASE	-0,83
CTT	-1,17



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.989,02	1,52%	-7,41%	5.801,45	4.783,34
CAC40	5.053,98	1,00%	-4,87%	5.657,44	4.894,30
ESTX 50 PR	3.214,99	1,32%	-8,25%	3.687,22	3.090,85
XTRA DAX	11.465,46	1,85%	-11,24%	13.596,89	11.009,25
S&P 500	2.780,37	0,74%	4,00%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	9.179,60	1,13%	-8,61%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	22.574,76	1,00%	-0,84%	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.