

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

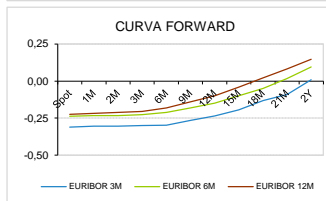
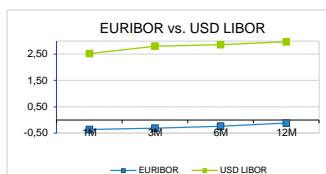
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

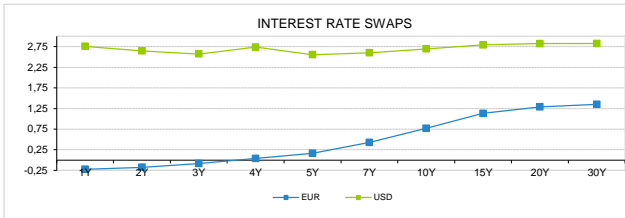
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3630	0	1	1M	2,5206	1	14	0,7301	-0,7826
3M	-0,3100	0	1	3M	2,8039	1	7	0,9054	-0,7116
6M	-0,2360	0	1	6M	2,8558	0	-4	1,0307	-0,6374
12M	-0,1190	0	2	12M	2,9649	-4	-17	1,1718	-0,4992

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2226	0	1	-0,1002	0,4270	1,0000
2Y	-0,1740	1	-2	0,0236	0,5740	1,1190
3Y	-0,0810	2	-6	0,1570	0,7150	1,2350
4Y	0,0370	1	-9	0,2970	0,8440	1,3360
5Y	0,1660	1	-10	0,4360	0,9670	1,4250
7Y	0,4270	1	-11	0,6940	1,1740	1,5664
10Y	0,7670	1	-10	1,0040	1,3895	1,6820
15Y	1,1310	2	-9	1,2972	1,5539	1,7420
20Y	1,2910	2	-9	1,4177	1,5954	1,7110
30Y	1,3510	2	-9	1,4390	1,5530	1,6325

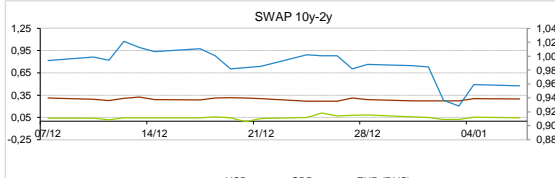
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7580	6	-17	2,5776	2,5207	3,1728
2Y	2,6470	7	-35	2,5314	2,5425	2,8377
3Y	2,5720	-3	-42	2,5248	2,6030	2,7305
4Y	2,7390	0	-27	2,4313	2,6230	2,8134
5Y	2,5540	10	-41	2,5490	2,6630	2,8421
7Y	2,6020	10	-37	2,6140	2,7552	2,8888
10Y	2,6940	10	-32	2,7055	2,8030	2,9162
15Y	2,7900	9	-29	2,7810	2,8400	2,9169
20Y	2,8210	-1	-28	2,8000	2,8400	2,8740
30Y	2,8250	9	-26	2,8150	2,8180	2,8370

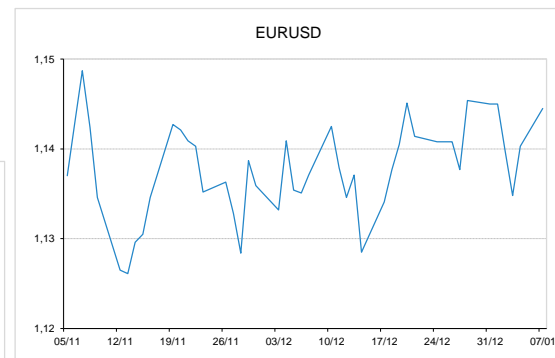
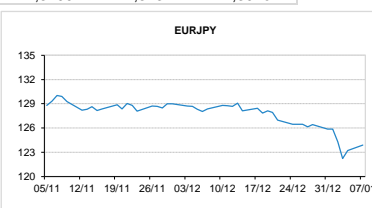


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	58,25	1,19	-3,60	OT 2Y	-0,226	0,03	0,30
JETFUEL	588,09	11,44	-37,87	OT 5Y	0,545	0,00	-3,20
DIESEL	546,59	11,19	-38,12	OT 10Y	1,822	0,01	1,00
COBRE	5.936,00	182,00	-291,00	BUND 10Y	-0,290	0,36	-2,70
ZINCO	2.466,00	61,00	-143,00	SCHATZ 2Y	0,041	1,15	2,00
OURO	1.288,20	3,73	41,52	T-NOTE 10Y	3,380	2,30	-17,70
TRIGO	516,00	-1,00	-15,25	T-NOTE 2Y	2,852	4,28	-23,00
LICENÇA C02	22,25	-1,48	1,61	GILT 10Y	1,476	-2,11	3,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1445	0,37%	0,65%	1,1534	1,1625	1,1809
EUR/GBP	0,8972	0,30%	-0,71%	0,9001	0,9033	0,9099
EUR/JPY	123,9	-0,57%	3,60%	123,90	123,90	123,90
EUR/CHF	1,1241	0,00%	0,34%	1,1230	1,1218	1,1193
EUR/BRL	4,2571	-0,47%	4,88%	4,3196	4,3865	4,5284
EUR/PLN	4,2964	-0,12%	-0,12%	4,3199	4,3437	4,3910



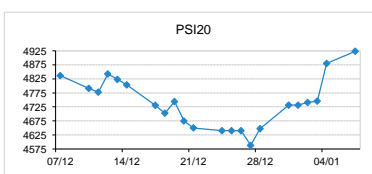
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1445	0,8972	123,90	1,1241	10,2059	7,4676	1,5247	1,6056	4,2571	9,7903
USD	0,8725	-	0,7833	108,435	0,9816	8,9075	6,5153	1,3314	1,4015	3,7194	8,5327

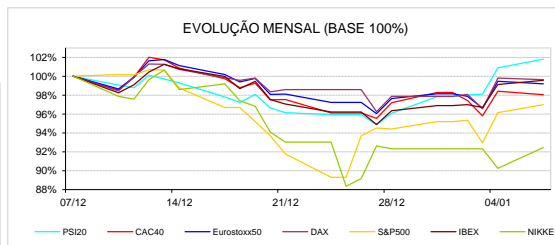
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,260	0,64	7,93
BCP	0,247	2,66	7,63
CORT. AMORIM	9,220	3,02	2,44
CTT	3,122	2,43	5,97
EDP	3,078	-0,68	0,95
EDP R	7,820	-0,51	0,58
GALP	14,490	0,69	5,04
IBERSOL	8,220	2,75	4,05
J MARTINS	10,750	1,56	3,97
MOTA ENGIL	1,764	5,63	9,57
NAVIGATOR	3,774	0,64	4,83
NOS	5,455	-0,09	3,02
NOVABASE	2,110	1,93	4,46
PHAROL	0,180	0,67	10,17
REN	2,542	1,19	4,44
SEMAPA	13,660	1,94	4,27
SONAE CAP.	0,878	0,23	3,42
SONAE SGPS	0,833	0,67	2,78

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	5,63
CORT. AMORIM	3,02
IBERSOL	2,75
BCP	2,66
CTT	2,43
NOS	-0,09
EDP R	-0,51
EDP	-0,68



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.923,87	0,90%	4,07%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.719,17	-0,38%	-0,24%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.033,64	-0,27%	1,07%	3.687,22	2.908,70
XTRA DAX	10.747,81	-0,18%	1,79%	13.596,89	10.279,20
S&P 500	2.556,61	0,88%	1,89%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	8.776,30	0,44%	2,77%	10.643,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.038,97	2,44%	0,12%	24.448,07	18.948,58



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.