

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

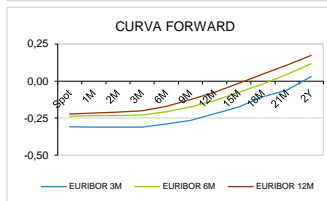
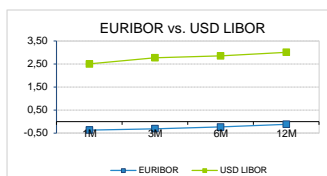
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

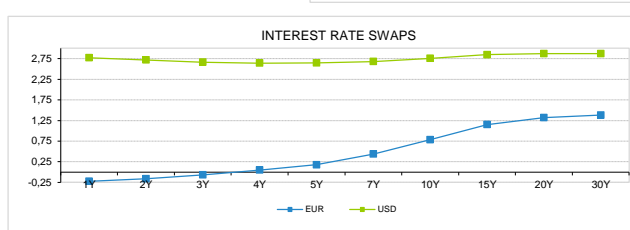
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,5030	-1	3	0,7344	-0,7784
3M	-0,3080	0	0	3M	2,7758	0	-3	0,9274	-0,7010
6M	-0,2350	0	0	6M	2,8525	-1	-5	1,0360	-0,6284
12M	-0,1160	0	1	12M	3,0119	-2	-9	1,1754	-0,5038

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2216	0	1	-0,0769	0,4450	1,0039
2Y	-0,1620	1	-2	0,0483	0,5897	1,1290
3Y	-0,0670	1	-5	0,1796	0,7272	1,2445
4Y	0,0500	1	-7	0,3171	0,8580	1,3450
5Y	0,1760	0	-8	0,4528	0,9800	1,4330
7Y	0,4370	0	-9	0,7098	1,1891	1,5782
10Y	0,7820	0	-8	1,0178	1,4028	1,6995
15Y	1,1510	-1	-7	1,3148	1,5728	1,7665
20Y	1,3180	-1	-5	1,4387	1,6176	1,7429
30Y	1,3790	-1	-5	1,4606	1,5750	1,6530

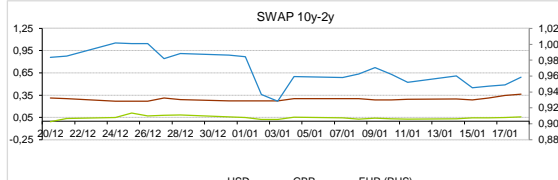
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



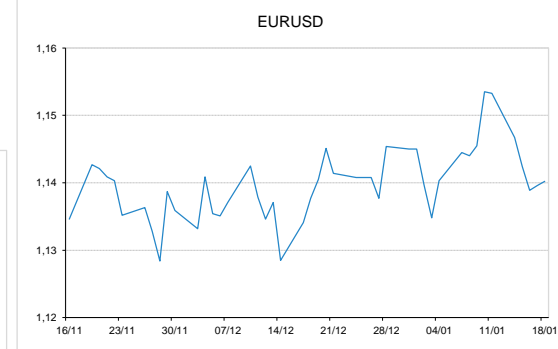
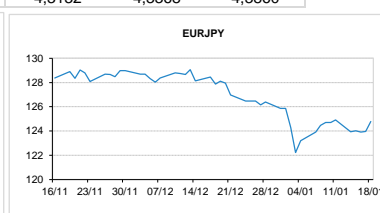
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7700	1	-10	2,7519	2,6552	2,7820
2Y	2,7180	2	-17	2,6175	2,6750	2,8456
3Y	2,6630	3	-19	2,6580	2,6810	2,8285
4Y	2,6410	3	-20	2,6575	2,7350	2,9164
5Y	2,6440	3	-19	2,7187	2,7700	2,9500
7Y	2,6790	2	-19	2,7265	2,8360	2,9948
10Y	2,7580	2	-17	2,8320	2,9376	3,0239
15Y	2,8450	1	-15	2,8890	2,9220	2,9745
20Y	2,8720	1	-15	2,9180	2,9736	2,9560
30Y	2,8690	0	-14	2,9035	2,8980	2,9629



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,74	1,56	6,51	OT 2Y	-0,158	-0,01	20,80
JETFUEL	616,50	12,00	39,65	OT 5Y	0,545	-0,03	15,80
DIESEL	577,75	11,75	42,75	OT 10Y	1,726	-0,03	7,70
COBRE	5.995,50	22,00	-131,00	BUND 10Y	-0,301	1,75	-5,00
ZINCO	2.564,25	53,75	21,25	SCHATZ 2Y	0,044	0,69	-1,60
OURO	1.282,33	-9,72	33,15	T-NOTE 10Y	3,477	3,81	0,20
TRIGO	518,25	0,50	-14,50	T-NOTE 2Y	2,944	4,10	-1,70
LICENÇA C02	24,83	1,16	0,50	GILT 10Y	1,573	1,35	7,90


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1402	0,05%	0,22%	1,1491	1,1580	1,1769
EUR/GBP	0,88125	0,15%	1,80%	0,8841	0,8871	0,8938
EUR/JPY	124,78	-0,67%	2,47%	124,78	124,78	124,78
EUR/CHF	1,1310	0,08%	-0,22%	1,1299	1,1288	1,1263
EUR/BRL	4,2804	-0,27%	3,68%	4,3381	4,4020	4,5417
EUR/PLN	4,2896	-0,04%	-0,12%	4,3132	4,3368	4,3860

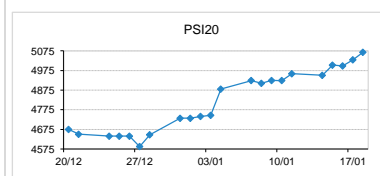

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1402	0,8813	124,78	1,1310	10,2476	7,4648	1,5057	1,58429	4,2804	9,7202
USD	0,8798	-	0,775	109,675	0,9955	9,0078	6,5672	1,3250	1,3920	3,7439	8,5440

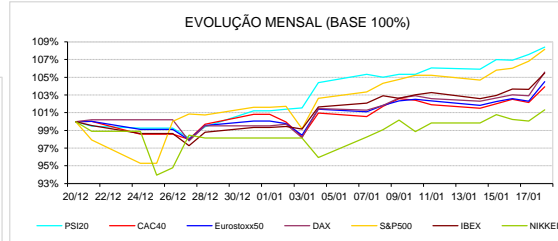
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,930	2,97	19,48
BCP	0,243	-0,41	5,75
CORT. AMORIM	9,670	1,26	7,44
CTT	3,064	0,79	4,01
EDP	3,075	0,46	0,85
EDP R	7,950	0,19	2,25
GALP	14,360	0,84	4,10
IBERSOL	8,620	2,62	9,11
J MARTINS	12,100	1,72	17,02
MOTA ENGIL	1,770	2,67	9,94
NAVIGATOR	4,150	0,58	15,28
NOS	5,495	0,83	3,78
NOVABASE	2,320	2,65	14,85
PHAROL	0,183	0,99	12,38
REN	2,546	0,24	4,60
SEMAPA	15,120	1,75	15,42
SONAE CAP.	0,866	0,23	2,00
SONAE SGPS	0,891	0,56	9,94

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	2,97
MOTA ENGIL	2,67
NOVABASE	2,65
IBERSOL	2,62
SEMAPA	1,75
BCP	-0,41



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.068,02	0,76%	7,11%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.875,93	1,70%	3,07%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.134,92	2,14%	4,45%	3.687,22	2.908,70
XTRA DAX	11.205,54	2,63%	6,12%	13.596,89	10.279,20
S&P 500	2.668,46	1,23%	6,44%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.069,10	1,80%	6,20%	10.643,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.666,07	1,29%	3,25%	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.