

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

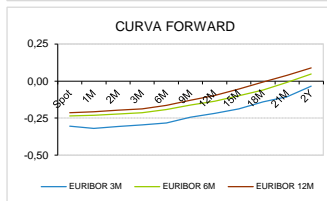
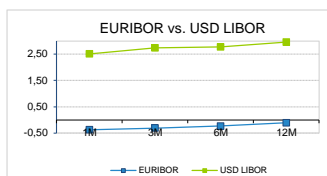
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

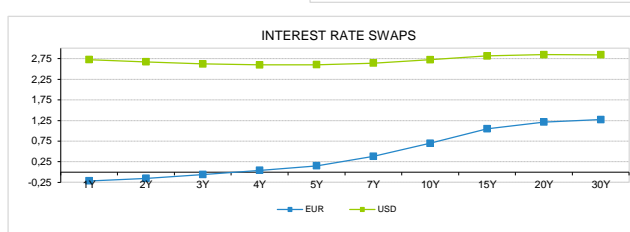
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	-1	1M	2,5126	0	-1	0,7311	-0,7798
3M	-0,3080	0	0	3M	2,7376	0	-7	0,9034	-0,7108
6M	-0,2330	0	0	6M	2,7763	0	-8	1,0218	-0,6518
12M	-0,1080	0	1	12M	2,9620	-2	0	1,1699	-0,5132

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2129	0	1	-0,0989	0,3000	0,7930
2Y	-0,1500	0	2	-0,0047	0,4160	0,9065
3Y	-0,0590	-1	2	0,0970	0,5410	1,0205
4Y	0,0430	-1	1	0,2060	0,6600	1,1210
5Y	0,1520	-1	-1	0,3220	0,7760	1,2100
7Y	0,3810	-2	-5	0,5510	0,9790	1,3550
10Y	0,6960	-2	-7	0,8450	1,2007	1,4920
15Y	1,0510	-2	-8	1,1453	1,3862	1,5720
20Y	1,2140	-2	-8	1,2716	1,4350	1,5530
30Y	1,2700	-2	-8	1,2975	1,3970	1,4660

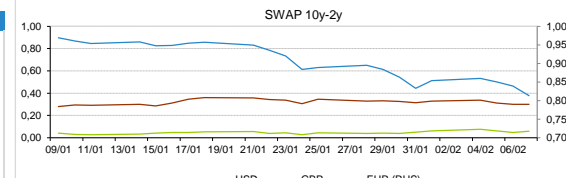
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



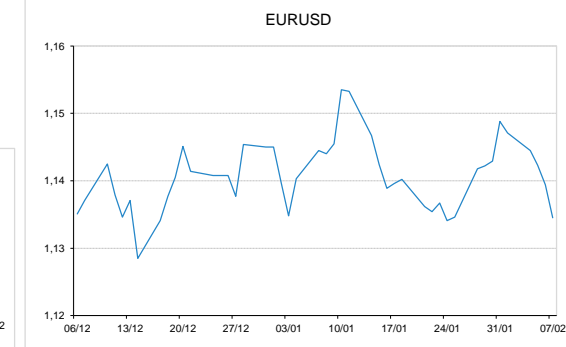
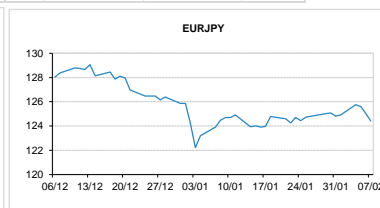
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7270	0	-3	2,5708	2,4660	2,6555
2Y	2,6710	-1	2	2,4765	2,5155	2,6860
3Y	2,6190	-1	5	2,4730	2,5610	2,7290
4Y	2,5980	-2	-14	2,4980	2,5925	2,7790
5Y	2,6030	-2	5	2,5280	2,6355	2,8358
7Y	2,6420	-3	4	2,5905	2,7085	2,8565
10Y	2,7220	-3	3	2,6950	2,7905	2,8910
15Y	2,8140	-3	2	2,7730	2,8360	2,8970
20Y	2,8440	-3	2	2,7955	2,8410	2,8830
30Y	2,8420	-3	2	2,7945	2,8205	2,8440



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	61,16	-1,53	3,61	OT 2Y	-0,200	0,01	0,70
JETFUEL	621,57	4,33	44,92	OT 5Y	0,459	-0,01	-10,00
DIESEL	585,57	2,58	50,17	OT 10Y	1,660	0,00	-16,30
COBRE	6.247,00	46,00	361,00	BUND 10Y	-0,465	-5,90	-18,80
ZINCO	2.714,00	-37,00	264,00	SCHATZ 2Y	0,041	-2,76	-0,90
OURO	1.310,74	-1,75	22,43	T-NOTE 10Y	3,365	-3,45	-4,70
TRIGO	513,75	-12,25	-3,00	T-NOTE 2Y	2,842	-3,90	-7,20
LICENÇA C02	23,39	-0,31	1,14	GILT 10Y	1,412	-4,00	-7,90


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1345	-0,43%	-0,87%	1,1434	1,1523	1,1705
EUR/GBP	0,8775	0,14%	2,25%	0,8802	0,8831	0,8893
EUR/JPY	124,41	0,51%	-0,41%	124,41	124,41	124,41
EUR/CHF	1,1367	0,24%	-1,05%	1,1356	1,1345	1,1320
EUR/BRL	4,2303	-0,55%	1,32%	4,2898	4,3553	4,4864
EUR/PLN	4,3086	-0,20%	-0,30%	4,3300	4,3522	4,3968


FIXINGS CONTRA USD e EUR

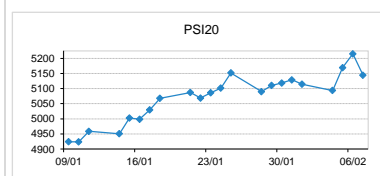
	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1345	0,8775	124,41	1,1367	10,4936	7,4634	1,5092	1,6009	4,2303	9,7435
USD	0,8806	-	0,7709	109,755	1,0011	9,2296	6,5725	1,3263	1,4072	3,7261	8,5700

ACCIONISTA

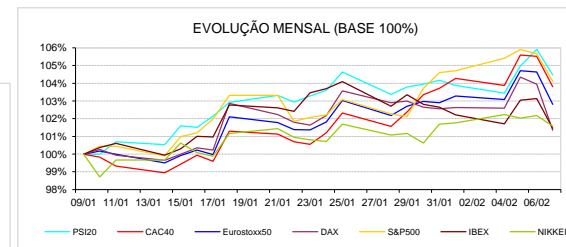
TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,250	-1,09	25,00
BCP	0,233	-3,56	1,48
CORT. AMORIM	9,760	-0,91	8,44
CTT	3,104	-1,40	5,36
EDP	3,219	-0,34	5,58
EDP R	7,875	-0,06	1,29
GALP	13,825	-2,91	0,22
IBERSOL	8,160	-0,49	3,29
J MARTINS	13,225	-0,53	27,90
MOTA ENGIL	1,858	-4,03	15,40
NAVIGATOR	4,258	-1,34	18,28
NOS	5,585	-0,27	5,48
NOVABASE	2,170	-3,13	7,43
PHAROL	0,179	-1,97	9,80
REN	2,630	-0,15	8,05
SEMAPA	14,920	-2,10	13,89
SONAE CAP.	0,892	-1,55	5,06
SONAE SGPS	0,903	-2,06	11,42

MAIORES GANHOS/PERDAS

Título	Variação %
SEMAPA	-2,10
GALP	-2,91
NOVABASE	-3,13
BCP	-3,56
MOTA ENGIL	-4,03



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.144,31	-1,36%	8,73%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.997,15	-1,61%	5,63%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.156,62	-1,75%	5,17%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.039,44	-2,52%	4,55%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.690,48	-1,48%	7,35%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	8.951,50	-1,64%	4,82%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.751,28	-0,59%	3,68%	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.