

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

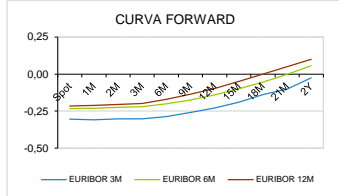
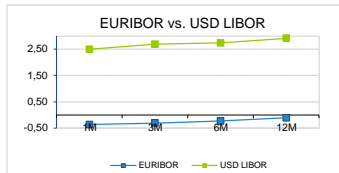
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

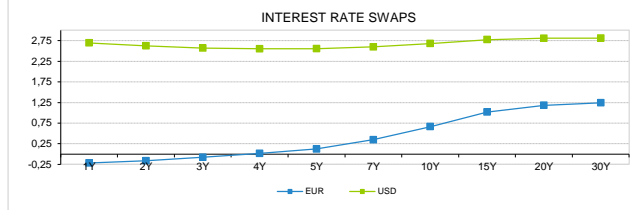
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4938	0	-2	0,7310	-0,7782
3M	-0,3080	0	0	3M	2,6929	0	-9	0,8683	-0,7132
6M	-0,2310	0	1	6M	2,7405	1	-12	0,9966	-0,6514
12M	-0,1080	0	1	12M	2,9153	-1	-10	1,1324	-0,5094

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2157	0	1	-0,0987	0,3142	0,7889
2Y	-0,1620	0	-1	0,0015	0,4350	0,9110
3Y	-0,0800	0	-3	0,1055	0,5531	1,0259
4Y	0,0170	1	-6	0,2194	0,6715	1,1302
5Y	0,1220	1	-8	0,3315	0,7855	1,2175
7Y	0,3470	2	-12	0,5595	0,9895	1,3661
10Y	0,6640	2	-14	0,8555	1,2059	1,5017
15Y	1,0190	2	-16	1,1467	1,3836	1,5786
20Y	1,1830	2	-16	1,2729	1,4352	1,5535
30Y	1,2440	2	-16	1,2992	1,3993	1,4723

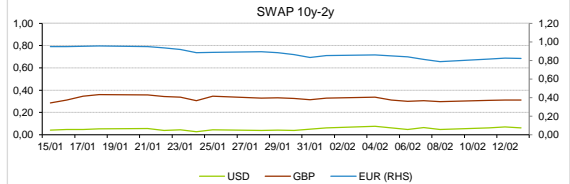
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



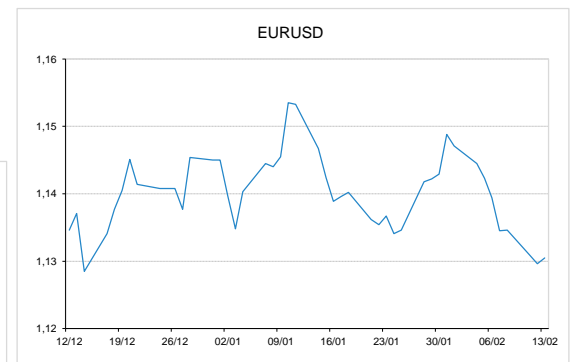
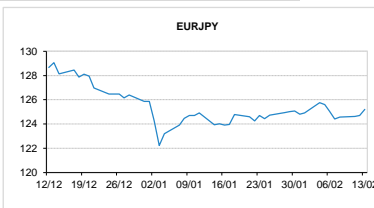
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6950	1	-7	2,6101	2,5318	2,6790
2Y	2,6240	2	-7	2,5340	2,5718	2,7190
3Y	2,5690	2	-6	2,5250	2,5930	2,7600
4Y	2,5500	3	-5	2,5410	2,6320	2,8020
5Y	2,5550	3	-5	2,5680	2,6740	2,8583
7Y	2,5960	3	-4	2,6300	2,7470	2,9112
10Y	2,6790	2	-4	2,7485	2,8230	2,9220
15Y	2,7740	2	-4	2,8095	2,8675	2,9551
20Y	2,8060	2	-3	2,8562	2,8740	2,9365
30Y	2,8080	2	-3	2,8518	2,8510	2,9008



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	63,52	1,10	2,89	OT 2Y	-0,228	-0,01	-3,60
JETFUEL	628,25	6,75	13,50	OT 5Y	0,375	-0,03	-7,80
DIESEL	598,50	7,75	27,75	OT 10Y	1,595	-0,04	-8,80
COBRE	6.123,00	-44,00	164,00	BUND 10Y	-0,455	-1,22	-11,70
ZINCO	2.605,50	-42,00	102,50	SCHATZ 2Y	0,057	0,46	3,40
OURO	1.313,06	2,54	22,77	T-NOTE 10Y	3,408	1,48	1,00
TRIGO	524,25	2,50	-0,75	T-NOTE 2Y	2,889	2,14	1,80
LICENÇA C02	20,95	0,25	-1,79	GILT 10Y	1,420	0,00	-10,10


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1305	0,08%	-1,41%	1,1391	1,1481	1,1668
EUR/GBP	0,87553	0,17%	1,95%	0,8782	0,8811	0,8874
EUR/JPY	125,19	-0,39%	-1,01%	125,19	125,19	125,19
EUR/CHF	1,1370	0,22%	-1,06%	1,1360	1,1348	1,1325
EUR/BRL	4,2319	-0,52%	0,22%	4,2914	4,3592	4,4934
EUR/PLN	4,3363	-0,10%	-1,04%	4,3580	4,3810	4,4276

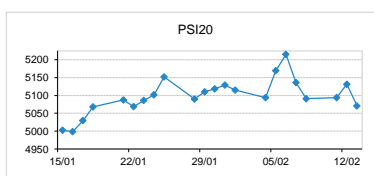

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1305	0,8755	125,19	1,1370	10,4327	7,4613	1,4924	1,58702	4,2319	9,7563
USD	0,8860	-	0,7764	110,865	1,0075	9,2327	6,6105	1,3235	1,4060	3,7468	8,6430

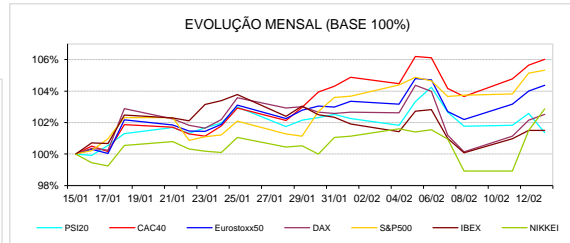
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,580	1,61	30,69
BCP	0,228	-2,39	-0,48
CORT. AMORIM	9,850	-2,28	9,44
CTT	3,094	-0,58	5,02
EDP	3,182	-0,25	4,36
EDP R	7,880	0,32	1,35
GALP	13,900	0,72	0,76
IBERSOL	7,900	-1,00	0,00
J MARTINS	12,700	-1,74	22,82
MOTA ENGIL	1,842	-2,64	14,41
NAVIGATOR	4,150	-2,44	15,28
NOS	5,280	-4,00	-0,28
NOVABASE	2,180	0,00	7,92
PHAROL	0,181	-0,44	10,66
REN	2,604	-0,61	6,98
SEMAPA	15,080	-1,57	15,11
SONAE CAP.	0,895	0,00	5,42
SONAE SGPS	0,907	-0,44	11,91

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	1,61
GALP	0,72
EDP R	0,32
CORT. AMORIM	-2,28
BCP	-2,39
NAVIGATOR	-2,44
MOTA ENGIL	-2,64
NOS	-4,00



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.070,67	-1,19%	7,17%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.074,27	0,35%	7,26%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.202,37	0,36%	6,70%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.167,22	0,37%	5,76%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.749,23	0,17%	9,68%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	8.982,40	-0,01%	5,18%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.144,48	1,34%	5,64%	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.