

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

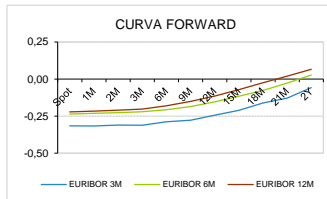
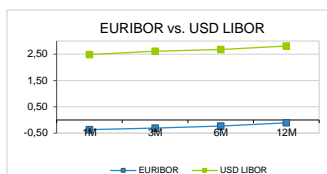
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

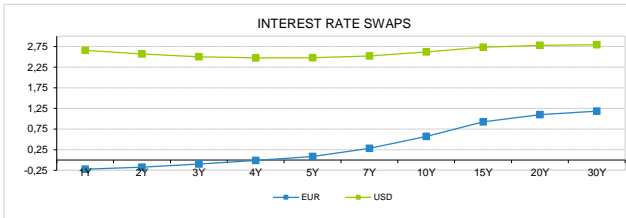
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4868	0	0	0,7291	-0,7852
3M	-0,3090	0	0	3M	2,6128	-2	-3	0,8396	-0,7132
6M	-0,2310	0	0	6M	2,6741	0	-6	0,9675	-0,6530
12M	-0,1090	0	0	12M	2,8104	-1	-8	1,1096	-0,5102

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2215	0	0	-0,1169	0,2655	0,6790
2Y	-0,1730	0	0	-0,0243	0,3655	0,7850
3Y	-0,0990	0	-1	0,0728	0,4700	0,8885
4Y	-0,0100	0	-3	0,1713	0,5749	0,9860
5Y	0,0840	-1	-4	0,2726	0,6775	1,0790
7Y	0,2810	-1	-6	0,4761	0,8700	1,2270
10Y	0,5700	-1	-8	0,7558	1,0910	1,3775
15Y	0,9250	-1	-8	1,0536	1,2855	1,4790
20Y	1,0990	-1	-7	1,1938	1,3561	1,4808
30Y	1,1840	-1	-5	1,2474	1,3465	1,4170

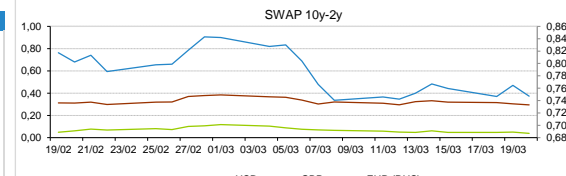
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suiza	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6590	1	-5	2,4586	2,3285	2,5395
2Y	2,5690	1	-8	2,3980	2,3870	2,5910
3Y	2,5040	2	-10	2,3670	2,4370	2,6400
4Y	2,4770	2	-10	2,4044	2,4870	2,7083
5Y	2,4780	1	-11	2,4130	2,5225	2,7486
7Y	2,5230	1	-10	2,5095	2,6456	2,8113
10Y	2,6190	1	-8	2,5975	2,7364	2,8330
15Y	2,7340	1	-6	2,7215	2,7988	2,8581
20Y	2,7800	0	-5	2,7607	2,7930	2,8360
30Y	2,7950	0	-4	2,7500	2,7840	2,8060

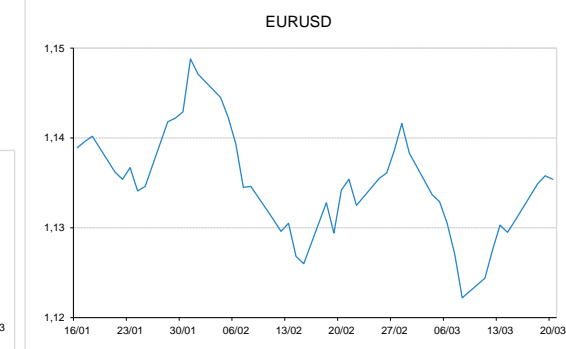
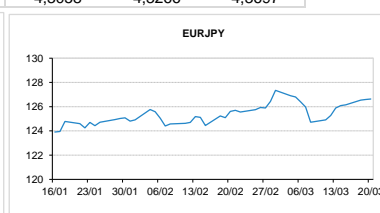


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	68,13	0,52	1,00	OT 2Y	-0,242	0,02	-0,60
JETFUEL	647,50	6,75	0,75	OT 5Y	0,244	0,00	-9,20
DIESEL	615,25	7,00	0,00	OT 10Y	1,315	0,01	-19,90
COBRE	6.459,00	34,00	140,00	BUND 10Y	-0,315	-2,12	-3,20
ZINCO	2.848,00	40,50	173,50	SCHATZ 2Y	0,083	-0,46	1,90
OURO	1.300,68	-6,92	-44,59	T-NOTE 10Y	3,290	-1,79	-6,20
TRIGO	459,50	3,00	-24,75	T-NOTE 2Y	2,780	-2,14	-5,40
LICENÇA C02	21,85	0,73	1,37	GILT 10Y	1,084	-4,15	-1,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1354	-0,04%	0,11%	1,1444	1,1531	1,1707
EUR/GBP	0,8628	-0,85%	0,77%	0,8656	0,8685	0,8745
EUR/JPY	126,63	-0,03%	-0,81%	126,63	126,63	126,63
EUR/CHF	1,1323	0,18%	0,22%	1,1313	1,1302	1,1279
EUR/BRL	4,3023	0,00%	-1,66%	4,3630	4,4284	4,5557
EUR/PLN	4,2843	0,08%	1,16%	4,3058	4,3266	4,3697



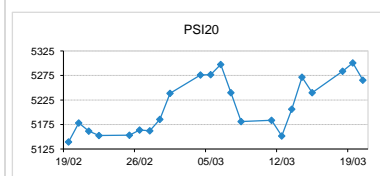
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1354	0,8628	126,63	1,1323	10,4221	7,4626	1,5132	1,60145	4,3023	9,6948
USD	0,8805	-	0,7582	111,425	0,9974	9,1815	6,5707	1,3340	1,4098	3,7915	8,5366

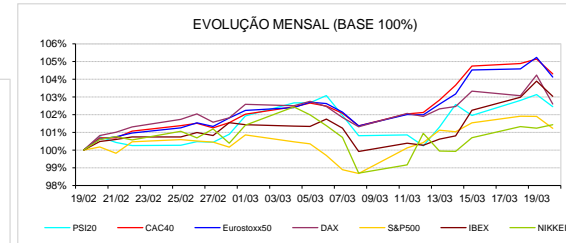
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,260	-1,09	25,17
BCP	0,229	-0,82	-0,17
CORT. AMORIM	10,780	0,56	19,78
CTT	2,740	-1,15	-6,99
EDP	3,333	-0,36	9,31
EDP R	8,600	-0,58	10,61
GALP	14,410	-2,11	4,46
IBERSOL	8,080	1,00	2,28
J MARTINS	13,380	-0,71	29,40
MOTA ENGIL	2,220	0,45	37,89
NAVIGATOR	4,260	-1,16	18,33
NOS	5,625	-0,53	6,23
NOVABASE	2,520	-1,56	24,75
PHAROL	0,213	3,66	30,21
REN	2,652	0,08	8,96
SEMAPA	14,980	-1,45	14,35
SONAE CAP.	0,895	0,34	5,42
SONAE SGPS	0,975	0,46	20,31

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	3,66
IBERSOL	1,00
CORT. AMORIM	0,56
SONAE SGPS	0,46
MOTA ENGIL	0,45
CTT	-1,15
NAVIGATOR	-1,16
SEMAPA	-1,45
NOVABASE	-1,56
GALP	-2,11



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.265,52	-0,66%	11,29%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.382,66	-0,80%	13,78%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.373,02	-1,06%	12,38%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.603,89	-1,57%	9,90%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.814,05	-0,65%	12,25%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.413,90	-0,83%	10,23%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.608,92	0,20%	7,96%	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.