

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

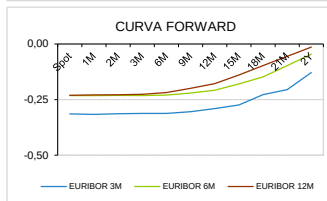
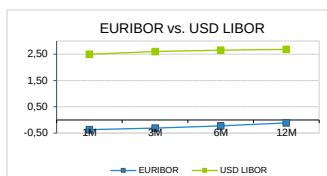
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

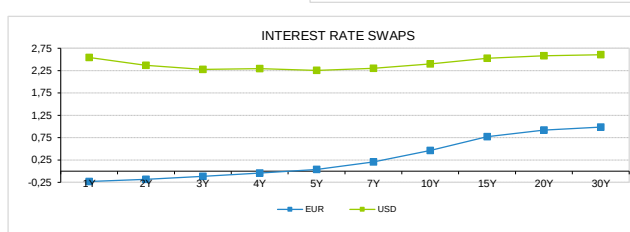
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4986	0	1	0,7318
3M	-0,3110	0	0	3M	2,6010	0	-3	0,8355
6M	-0,2280	0	0	6M	2,6508	-3	-3	0,9515
12M	-0,1120	0	0	12M	2,6829	-4	-18	1,0588
								-0,5024

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,2310	0	-2	-0,1790	0,1217	0,5260	
2Y	-0,1820	0	-3	-0,0959	0,2258	0,6255	
3Y	-0,1170	0	-5	-0,0215	0,3278	0,7285	
4Y	-0,0420	-1	-7	0,0660	0,4300	0,8250	
5Y	0,0390	-1	-9	0,1575	0,5305	0,9140	
7Y	0,2060	-2	-14	0,3485	0,7160	1,0570	
10Y	0,4620	-3	-19	0,6150	0,9298	1,1975	
15Y	0,7710	-4	-24	0,9005	1,1173	1,2935	
20Y	0,9200	-4	-26	1,0321	1,1810	1,2955	
30Y	0,9860	-5	-26	1,0795	1,1690	1,2345	

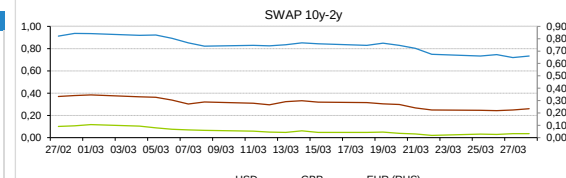
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5420	-1	-11	2,1584	2,1065	2,3380
2Y	2,3660	0	-21	2,1020	2,1890	2,3640
3Y	2,2750	0	-25	2,0960	2,2130	2,3955
4Y	2,2930	-10	-25	2,0910	2,2395	2,4780
5Y	2,2540	0	-26	2,1490	2,3100	2,5394
7Y	2,3000	0	-26	2,2370	2,3960	2,5540
10Y	2,4000	0	-25	2,3770	2,4575	2,5985
15Y	2,5260	-1	-23	2,4675	2,5590	2,6405
20Y	2,5800	-1	-22	2,5105	2,5745	2,6340
30Y	2,6050	-1	-20	2,5320	2,5720	2,6040

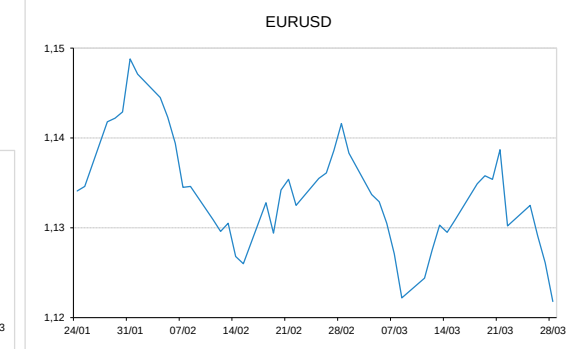
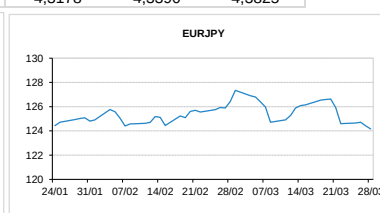


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	67,38	-0,45	1,07	OT 2Y	-0,304	0,00	-5,30
JETFUEL	639,75	-6,50	-15,25	OT 5Y	0,181	0,00	-9,00
DIESEL	605,75	-6,00	-24,98	OT 10Y	1,270	0,01	-16,20
COBRE	6.336,00	5,00	-171,50	BUND 10Y	-0,467	1,65	-19,10
ZINCO	2.930,00	15,00	166,50	SCHATZ 2Y	0,018	1,38	-6,50
OURO	1.289,71	-20,19	-25,54	T-NOTE 10Y	3,131	2,25	-18,60
TRIGO	464,50	-5,00	5,00	T-NOTE 2Y	2,570	2,71	-22,00
LICENÇA C02	22,30	0,45	0,61	GILT 10Y	0,922	0,00	-22,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1218	-0,38%	-1,73%	1,1304	1,1389	1,1554
EUR/GBP	0,8555	-0,51%	0,33%	0,8583	0,8611	0,8668
EUR/JPY	124,16	0,21%	1,84%	124,16	124,16	124,16
EUR/CHF	1,1182	0,17%	1,53%	1,1172	1,1161	1,1138
EUR/BRL	4,436	1,24%	-3,77%	4,5002	4,5725	4,7088
EUR/PLN	4,2972	-0,13%	0,15%	4,3178	4,3390	4,3825



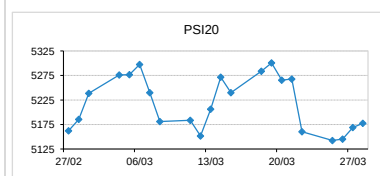
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1218	0,8556	124,16	1,1182	10,4454	7,4644	1,5082	1,58766	4,4360	9,7125
USD	0,8902	-	0,7637	110,665	0,9966	9,3050	6,6445	1,3406	1,4117	3,9662	8,6450

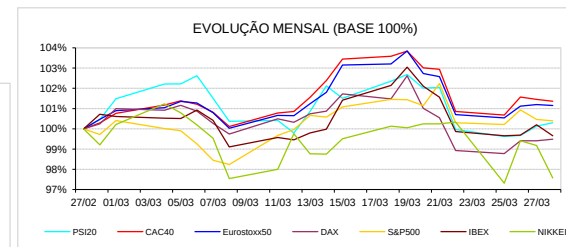
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,910	1,02	19,14
BCP	0,230	0,17	0,00
CORT. AMORIM	10,700	0,38	18,89
CTT	2,560	0,39	-13,10
EDP	3,504	0,40	14,92
EDP R	8,440	0,48	8,55
GALP	14,130	-0,35	2,43
IBERSOL	7,720	-1,28	-2,28
J MARTINS	12,995	0,66	25,68
MOTA ENGIL	2,020	-0,49	25,47
NAVIGATOR	4,040	0,35	12,22
NOS	5,655	0,18	6,80
NOVABASE	2,500	-0,40	23,76
PHAROL	0,192	0,52	17,40
REN	2,540	0,00	4,35
SEMAPA	14,420	-0,41	10,08
SONAE CAP.	0,875	-0,57	3,06
SONAE SGPS	0,926	-0,86	14,32

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	1,02
J MARTINS	0,66
PHAROL	0,52
EDP R	0,48
EDP	0,40
SEMAPA	-0,41
MOTA ENGIL	-0,49
SONAE CAP.	-0,57
SONAE SGPS	-0,86
IBERSOL	-1,28



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.177,40	0,17%	9,42%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.296,54	-0,09%	11,96%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.320,66	-0,04%	10,64%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.428,16	0,08%	8,23%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.803,54	-0,07%	11,83%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.179,90	-0,54%	7,49%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.033,76	-1,61%	5,09%	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.