

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

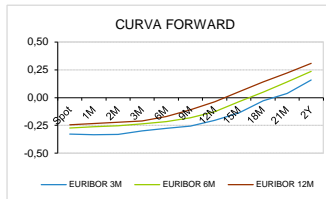
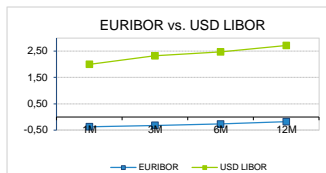
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

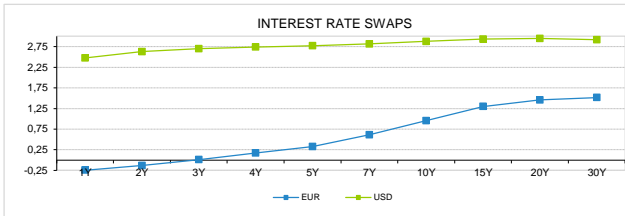
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	2,0007	2	9	0,4958	-0,7956
3M	-0,3210	0	1	3M	2,3213	2	-4	0,6115	-0,7348
6M	-0,2690	0	0	6M	2,4738	1	-4	0,7192	-0,6480
12M	-0,1840	0	1	12M	2,7181	2	-5	0,8878	-0,5288

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2435	-1	1	-0,0397	0,6418	1,1859
2Y	-0,1320	1	1	0,1327	0,7902	1,2986
3Y	0,0120	3	-3	0,3021	0,9209	1,3945
4Y	0,1720	4	-6	0,4588	1,0422	1,4805
5Y	0,3290	5	-7	0,6016	1,1492	1,5590
7Y	0,6130	5	-7	0,8520	1,3301	1,6734
10Y	0,9530	4	-6	1,1388	1,5195	1,7863
15Y	1,2990	4	-4	1,4132	1,6710	1,8458
20Y	1,4570	3	-3	1,5301	1,7086	1,8152
30Y	1,5160	3	-1	1,5537	1,6705	1,7360

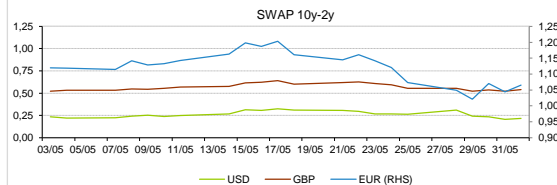
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



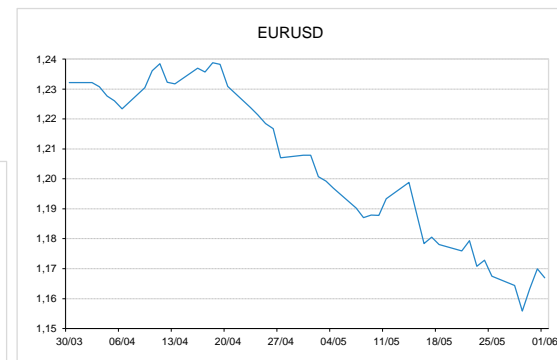
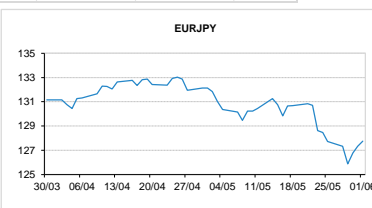
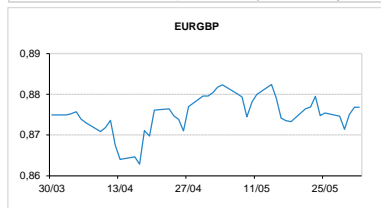
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,4740	-1	-8	2,9141	2,9345	2,9440
2Y	2,6270	-3	-12	2,9160	2,9689	2,9500
3Y	2,7010	-4	-14	2,9310	2,9355	2,9715
4Y	2,7420	-4	-15	2,9240	2,9425	2,9900
5Y	2,7700	-4	-14	2,9270	2,9515	3,0353
7Y	2,8150	-3	-13	2,9415	2,9805	3,0280
10Y	2,8750	-2	-11	3,0097	2,9840	3,0310
15Y	2,9320	-2	-9	3,0000	3,0195	3,0020
20Y	2,9450	-2	-9	2,9831	2,9920	3,0230
30Y	2,9160	-2	-9	2,9510	2,9390	2,9592



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	76,55	-1,01	3,85	OT 2Y	-0,006	-0,03	17,10
JETFUEL	715,33	-11,25	17,54	OT 5Y	0,720	-0,09	13,40
DIESEL	674,08	-10,50	24,54	OT 10Y	1,873	-0,11	18,00
COBRE	6.828,00	12,00	45,00	BUND 10Y	-0,112	4,75	-21,90
ZINCO	3.105,50	-29,00	-23,50	SCHATZ 2Y	-0,041	4,35	-8,50
OURO	1.296,69	-5,18	-10,45	T-NOTE 10Y	3,612	5,87	-8,00
TRIGO	520,75	-5,50	-8,50	T-NOTE 2Y	2,899	6,63	-8,90
LICENÇA C02	15,30	0,39	1,91	GILT 10Y	1,515	4,60	-19,80


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1669	-0,26%	-3,39%	1,1751	1,1839	1,2035
EUR/GBP	0,8768	0,00%	0,32%	0,8791	0,8818	0,8878
EUR/JPY	127,74	-0,32%	3,43%	127,74	127,74	127,74
EUR/CHF	1,1523	-0,28%	3,72%	1,1511	1,1499	1,1476
EUR/BRL	4,3875	-0,94%	-3,54%	4,4571	4,5229	4,6696
EUR/PLN	4,3054	0,24%	-0,77%	4,3279	4,3505	4,3981

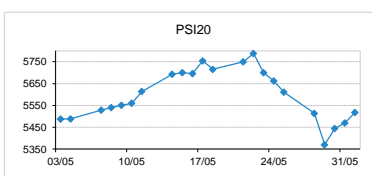

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1669	0,8768	127,74	1,1523	10,3051	7,4441	1,5123	1,54406	4,3875	9,5381
USD	0,8575	-	0,75	109,555	0,9882	8,8361	6,3828	1,2955	1,3230	3,7535	8,1831

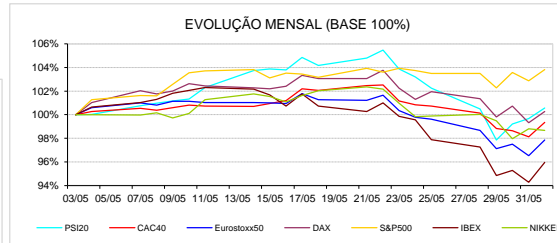
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,910	0,13	52,97
BCP	0,264	4,94	-3,09
CORT. AMORIM	11,3200	-0,18	9,90
CTT	2,8540	0,49	-18,62
EDP	3,367	0,51	16,71
EDP R	7,950	-1,18	14,11
GALP	15,955	0,38	4,11
IBERSOL	10,950	-0,90	-9,88
J MARTINS	13,535	0,63	-16,42
MOTA ENGIL	3,230	-0,62	-11,82
NAVIGATOR	5,445	1,97	28,06
NOS	4,624	0,74	-15,64
NOVABASE	2,730	1,11	-10,46
PHAROL	0,268	5,51	7,20
REN	2,356	-0,93	-4,96
SEMAPA	21,850	1,39	22,79
SONAE CAP.	0,933	2,19	5,19
SONAE SGPS	1,060	0,28	-5,86

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	5,51
BCP	4,94
SONAE CAP.	2,19
NAVIGATOR	1,97
SEMAPA	1,39
CORT. AMORIM	-0,18
MOTA ENGIL	-0,62
IBERSOL	-0,90
REN	-0,93
EDP R	-1,18



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.517,49	0,89%	2,40%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.465,53	1,24%	2,88%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.453,54	1,38%	-1,44%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.724,27	0,95%	-1,50%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.730,07	0,91%	2,11%	2.872,87	2.405,70
IBEX 35	9.632,40	1,76%	-4,10%	11.048,00	9.327,60
NIKKEI 225	22.171,35	-0,14%	-2,61%	24.129,34	19.239,52



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.