

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

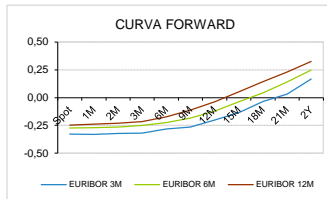
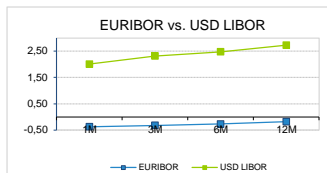
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

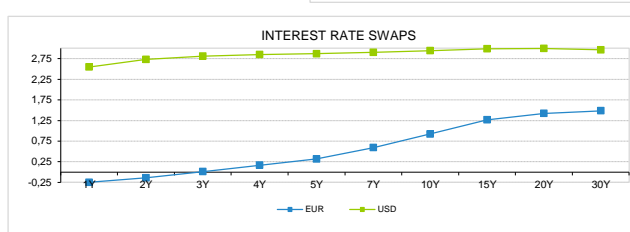
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	2,0047	0	10	0,4993	-0,7936
3M	-0,3210	0	1	3M	2,3178	0	-4	0,6174	-0,7348
6M	-0,2690	0	0	6M	2,4744	0	-4	0,7254	-0,6480
12M	-0,1840	0	1	12M	2,7241	1	-4	0,8950	-0,5288

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2487	-1	1	-0,0390	0,6691	1,2240
2Y	-0,1380	-1	0	0,1417	0,8198	1,3350
3Y	0,0120	0	-3	0,3163	0,9540	1,4345
4Y	0,1670	-1	-7	0,4765	1,0760	1,5220
5Y	0,3180	-1	-9	0,6235	1,1860	1,5970
7Y	0,5940	-2	-9	0,8812	1,3695	1,7203
10Y	0,9220	-3	-9	1,1705	1,5568	1,8230
15Y	1,2670	-3	-7	1,4483	1,7108	1,8810
20Y	1,4240	-3	-6	1,5614	1,7443	1,8510
30Y	1,4850	-3	-4	1,5841	1,7019	1,7660

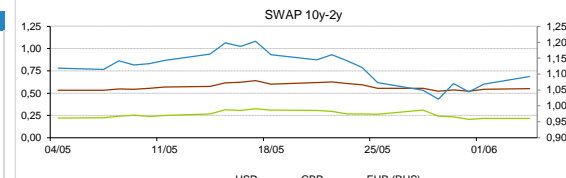
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



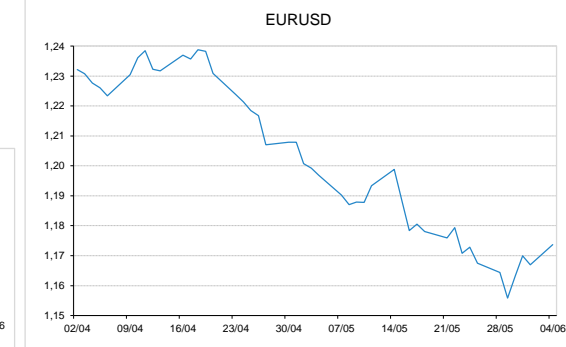
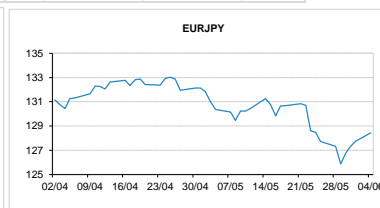
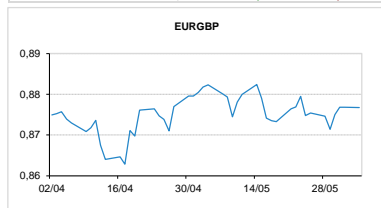
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5460	7	-1	2,9563	2,9770	2,9740
2Y	2,7280	5	-3	2,9860	2,9810	2,9750
3Y	2,8080	11	-5	2,9926	3,0032	3,0287
4Y	2,8470	11	-6	2,9480	3,0082	3,0454
5Y	2,8680	6	-6	2,9968	3,0175	3,0609
7Y	2,8990	6	-6	3,0085	3,0110	3,0836
10Y	2,9430	6	-6	3,0396	3,0673	3,0630
15Y	2,9890	6	-6	3,0390	3,0723	3,0560
20Y	2,9970	6	-6	3,0536	3,0300	3,0477
30Y	2,9620	6	-6	3,0074	3,0004	2,9580



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	75,70	-1,09	1,18	OT 2Y	-0,057	-0,05	14,80
JETFUEL	708,73	-6,60	8,73	OT 5Y	0,641	-0,09	10,30
DIESEL	667,48	-6,60	13,23	OT 10Y	1,762	-0,12	11,50
COBRE	6.904,50	44,00	151,00	BUND 10Y	-0,062	4,70	-11,80
ZINCO	3.107,75	2,25	56,25	SCHATZ 2Y	-0,037	0,23	-6,90
OURO	1.293,70	-1,90	-19,73	T-NOTE 10Y	3,639	2,19	-3,20
TRIGO	508,75	-14,50	-17,50	T-NOTE 2Y	2,938	3,90	-3,50
LICENÇA C02	16,14	0,85	3,12	GILT 10Y	1,543	2,12	-10,20


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1737	0,58%	-1,94%	1,1819	1,1907	1,2104
EUR/GBP	0,87673	0,01%	0,64%	0,8791	0,8818	0,8878
EUR/JPY	128,44	-0,55%	1,50%	128,44	128,44	128,44
EUR/CHF	1,1563	-0,37%	3,44%	1,1552	1,1540	1,1518
EUR/BRL	4,3794	0,29%	-3,59%	4,4497	4,5139	4,6613
EUR/PLN	4,2877	0,39%	-0,94%	4,3099	4,3322	4,3792

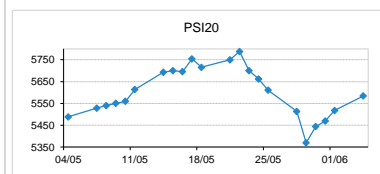

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1737	0,8767	128,44	1,1563	10,2368	7,4428	1,5117	1,52934	4,3794	9,4928
USD	0,8551	-	0,75	109,615	0,9881	8,7647	6,3638	1,2928	1,3078	3,7448	8,1261

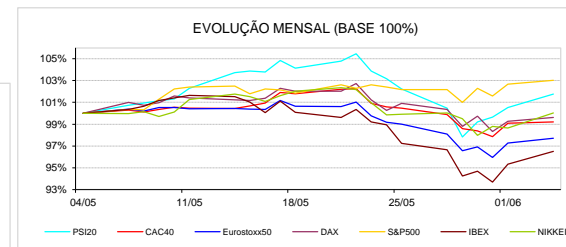
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	8,000	1,14	54,71
BCP	0,267	1,37	-1,76
CORT. AMORIM	11,4000	0,71	10,68
CTT	2,8420	-0,42	-18,96
EDP	3,419	1,54	18,51
EDP R	8,170	2,77	17,27
GALP	16,050	0,60	4,73
IBERSOL	11,000	0,46	-9,47
J MARTINS	13,695	1,18	-15,44
MOTA ENGIL	3,390	4,95	-7,45
NAVIGATOR	5,565	2,20	30,88
NOS	4,680	1,21	-14,61
NOVABASE	2,740	0,37	-10,13
PHAROL	0,268	-0,19	7,00
REN	2,370	0,59	-4,40
SEMAPA	22,000	0,69	23,63
SONAE CAP.	0,933	0,00	5,19
SONAE SGPS	1,046	-1,32	-7,10

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	4,95
EDP R	2,77
NAVIGATOR	2,20
EDP	1,54
BCP	1,37
PHAROL	-0,19
CTT	-0,42
SONAE SGPS	-1,32



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.584,20	1,21%	3,64%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.472,91	0,14%	3,02%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.469,57	0,46%	-0,98%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.770,75	0,37%	-1,14%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.744,13	0,35%	2,64%	2.872,87	2.405,70
IBEX 35	9.750,30	1,22%	-2,92%	11.048,00	9.327,60
NIKKEI 225	22.475,94	1,37%	-1,27%	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.