

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

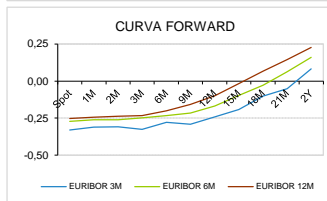
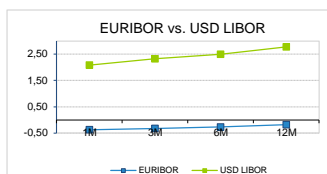
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

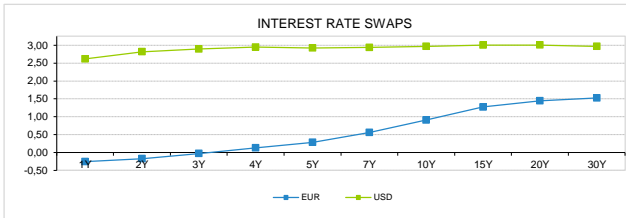
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3700	0	0	1M	2,0838	0	13	0,5055	-0,7854
3M	-0,3230	0	0	3M	2,3247	0	0	0,6308	-0,7312
6M	-0,2680	0	0	6M	2,4969	-1	0	0,7550	-0,6426
12M	-0,1810	0	1	12M	2,7719	0	1	0,9356	-0,5234

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2525	0	-1	-0,1002	0,5610	1,1200
2Y	-0,1710	0	-5	0,0635	0,7070	1,2430
3Y	-0,0280	-1	-10	0,2286	0,8440	1,3550
4Y	0,1320	-1	-13	0,3834	0,9740	1,4550
5Y	0,2850	-2	-16	0,5292	1,0930	1,5347
7Y	0,5630	-2	-18	0,7937	1,2940	1,6787
10Y	0,9060	-2	-17	1,1039	1,5006	1,7850
15Y	1,2730	-1	-15	1,3981	1,6707	1,8550
20Y	1,4460	0	-13	1,5247	1,7142	1,8340
30Y	1,5250	0	-11	1,5595	1,6848	1,7590

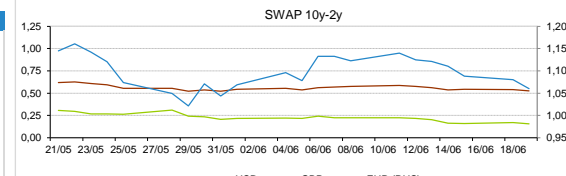
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



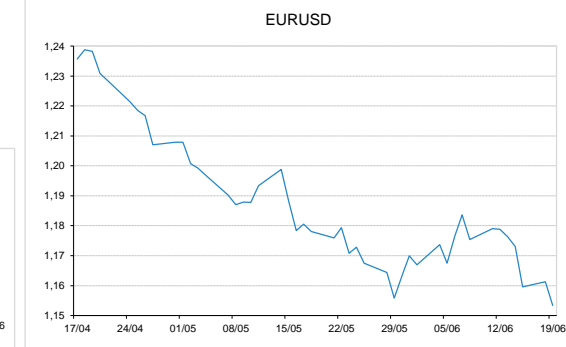
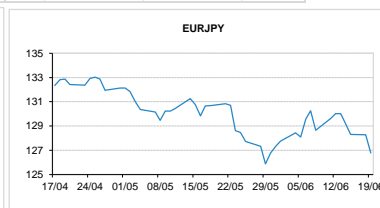
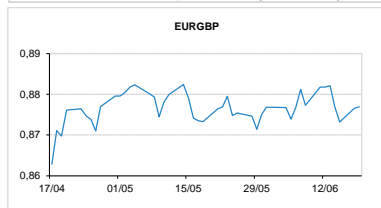
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6190	1	9	3,0030	2,9705	2,9524
2Y	2,8180	-2	4	2,9560	2,9450	2,9220
3Y	2,8950	-2	0	2,9800	2,9345	2,9350
4Y	2,9460	1	5	2,9550	2,9230	2,9650
5Y	2,9260	-3	-6	2,9590	2,9520	3,0083
7Y	2,9380	-4	-9	2,9560	2,9700	2,9885
10Y	2,9670	-4	-12	3,0093	2,9810	3,0070
15Y	3,0030	-4	-13	2,9840	3,0257	2,9905
20Y	3,0060	-4	-14	2,9935	2,9690	2,9630
30Y	2,9700	-4	-14	2,9250	2,9576	2,9045



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	74,93	-0,41	-3,56	OT 2Y	-0,144	0,00	0,00
JETFUEL	694,91	1,66	-51,09	OT 5Y	0,610	-0,01	-8,10
DIESEL	653,41	1,41	-47,59	OT 10Y	1,738	-0,01	-13,00
COBRE	6.972,00	-56,00	109,00	BUND 10Y	-0,114	-2,75	-23,20
ZINCO	3.075,50	-15,75	-26,50	SCHATZ 2Y	-0,009	-1,38	-9,90
OURO	1.275,62	-3,00	-17,06	T-NOTE 10Y	3,616	-2,86	-14,90
TRIGO	489,50	-12,00	-44,50	T-NOTE 2Y	2,957	-1,56	-8,20
LICENÇA C02	14,22	-0,38	-1,03	GILT 10Y	1,519	-3,85	-22,50


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1534	-0,68%	-1,91%	1,1614	1,1700	1,1895
EUR/GBP	0,87693	-0,04%	-0,06%	0,8793	0,8819	0,8879
EUR/JPY	126,78	1,18%	3,20%	126,78	126,78	126,78
EUR/CHF	1,1523	0,21%	1,95%	1,1511	1,1498	1,1474
EUR/BRL	4,3217	0,71%	0,27%	4,3917	4,4610	4,6215
EUR/PLN	4,3069	-0,23%	-0,29%	4,3304	4,3548	4,4023

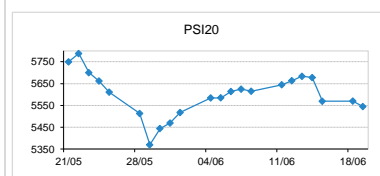

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1534	0,8769	126,78	1,1523	10,3112	7,4540	1,5363	1,5681	4,3217	9,4830
USD	0,8647	-	0,7593	109,845	0,9955	8,9463	6,4462	1,3273	1,3573	3,7514	8,2116

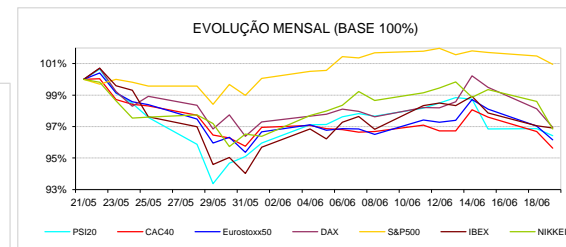
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,350	-1,07	61,48
BCP	0,268	1,21	-1,40
CORT. AMORIM	11,5000	1,41	11,65
CTT	3,0280	2,44	-13,66
EDP	3,380	-0,29	17,16
EDP R	8,345	-0,06	19,78
GALP	15,765	-1,75	2,87
IBERSOL	11,650	2,19	-4,12
J MARTINS	12,775	-2,26	-21,12
MOTA ENGIL	2,985	-1,16	-18,51
NAVIGATOR	5,315	-0,56	25,94
NOS	4,692	-0,17	-14,40
NOVABASE	2,760	0,00	-9,48
PHAROL	0,244	1,46	-2,40
REN	2,390	0,25	-3,59
SEMAPA	22,800	-1,94	28,13
SONAE CAP.	0,908	-0,22	2,37
SONAE SGPS	1,103	-1,34	-2,04

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	2,44
IBERSOL	2,19
PHAROL	1,46
CORT. AMORIM	1,41
BCP	1,21
MOTA ENGIL	-1,16
SONAE SGPS	-1,34
GALP	-1,75
SEMAPA	-1,94
J MARTINS	-2,26



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.544,50	-0,45%	2,90%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.390,63	-1,10%	1,47%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.435,30	-0,90%	-1,96%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.677,97	-1,22%	-1,86%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.759,28	-0,52%	3,21%	2.872,87	2.405,70
IBEX 35	9.755,40	-0,14%	-2,87%	10.901,50	9.327,60
NIKKEI 225	22.278,48	-1,77%	-2,14%	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.