

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

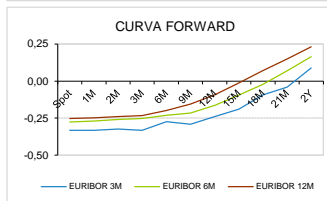
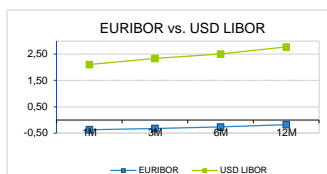
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

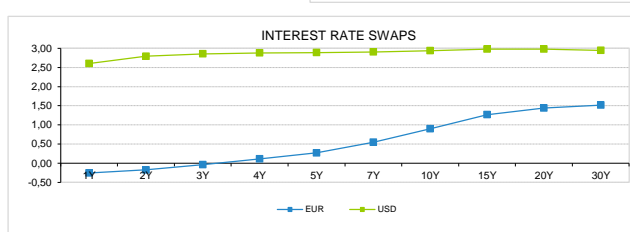
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3700	0	0	1M	2,1019	0	13	0,5015	-0,7800
3M	-0,3240	0	0	3M	2,3356	0	2	0,6644	-0,7312
6M	-0,2700	0	0	6M	2,5025	0	2	0,7841	-0,6450
12M	-0,1810	0	1	12M	2,7709	1	4	0,9643	-0,5206

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2530	0	-2	-0,0931	0,5747	1,1412
2Y	-0,1750	0	-2	0,0705	0,7234	1,2583
3Y	-0,0380	0	-4	0,2384	0,8579	1,3662
4Y	0,1150	1	-6	0,3967	0,9880	1,4653
5Y	0,2680	1	-8	0,5427	1,1045	1,5491
7Y	0,5480	2	-8	0,8015	1,3053	1,6787
10Y	0,8980	2	-7	1,1139	1,5051	1,7959
15Y	1,2690	2	-5	1,3992	1,6665	1,8595
20Y	1,4400	2	-3	1,5233	1,7121	1,8355
30Y	1,5170	2	-2	1,5586	1,6826	1,7569

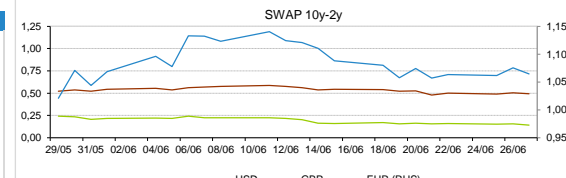
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



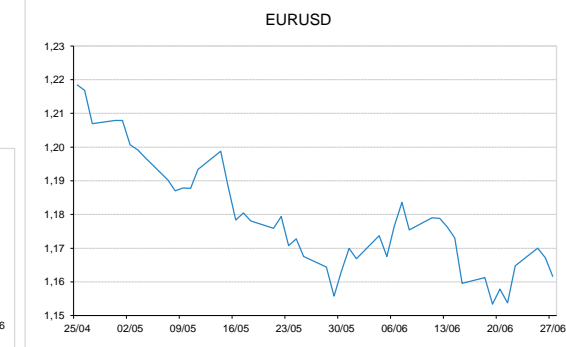
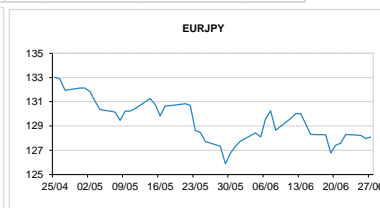
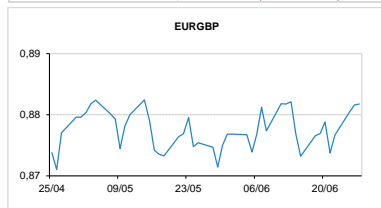
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6030	-1	8	2,9572	2,9288	2,8745
2Y	2,7920	-1	8	2,9581	2,9189	2,8880
3Y	2,8550	-2	5	2,9270	2,8875	2,9163
4Y	2,8810	-2	3	2,9130	2,8890	2,9200
5Y	2,8900	-2	1	2,9225	2,8980	2,9675
7Y	2,9050	-3	-1	2,9090	2,9379	2,9680
10Y	2,9390	-3	-3	2,9642	2,9560	3,0043
15Y	2,9770	-3	-4	2,9600	2,9670	2,9932
20Y	2,9780	-3	-5	2,9500	2,9440	2,9670
30Y	2,9450	-3	-5	2,9070	2,8930	2,8810



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	78,09	1,78	1,62	OT 2Y	-0,103	-0,01	-21,70
JETFUEL	712,22	16,97	-14,78	OT 5Y	0,687	-0,04	-20,70
DIESEL	671,09	15,84	-15,16	OT 10Y	1,848	-0,04	-22,30
COBRE	6.727,00	-42,00	-172,00	BUND 10Y	-0,168	-1,26	-3,00
ZINCO	2.860,75	-19,75	-190,25	SCHATZ 2Y	-0,048	-0,46	0,00
OURO	1.254,87	-4,97	-48,80	T-NOTE 10Y	3,572	-2,85	-7,90
TRIGO	488,25	5,25	-71,50	T-NOTE 2Y	2,918	-2,34	-1,20
LICENÇA C02	15,24	0,21	-0,76	GILT 10Y	1,479	-4,70	-9,50


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1616	-0,48%	-0,24%	1,1695	1,1785	1,1972
EUR/GBP	0,88173	-0,01%	-0,80%	0,8842	0,8870	0,8928
EUR/JPY	128,08	-0,10%	-0,59%	128,08	128,08	128,08
EUR/CHF	1,1546	0,05%	0,06%	1,1535	1,1523	1,1500
EUR/BRL	4,4614	-0,74%	-2,58%	4,5298	4,6007	4,7578
EUR/PLN	4,3477	-0,37%	-1,06%	4,3715	4,3967	4,4434

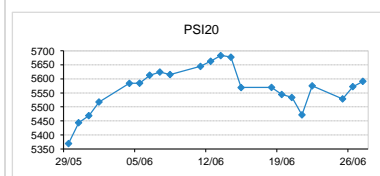

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1616	0,8817	128,08	1,1546	10,3569	7,4506	1,5404	1,57198	4,4614	9,4500
USD	0,8623	-	0,7606	110,46	0,9950	8,9252	6,4246	1,3287	1,3546	3,8390	8,1518

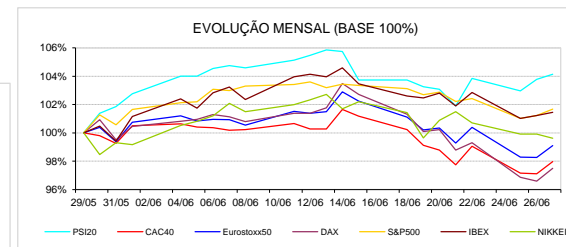
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,780	1,50	69,79
BCP	0,260	-1,44	-4,60
CORT. AMORIM	11,5200	3,78	11,84
CTT	2,9960	-1,19	-14,57
EDP	3,430	0,59	18,89
EDP R	8,880	-0,11	27,46
GALP	16,250	1,37	6,04
IBERSOL	11,850	-0,42	-2,47
J MARTINS	13,070	0,50	-19,30
MOTA ENGIL	3,025	4,31	-17,42
NAVIGATOR	5,180	0,19	22,74
NOS	4,722	-0,30	-13,85
NOVABASE	2,770	0,73	-9,15
PHAROL	0,238	-1,86	-5,00
REN	2,374	0,76	-4,24
SEMAPA	22,900	0,88	28,69
SONAE CAP.	0,912	1,90	2,82
SONAE SGPS	1,070	-0,93	-4,97

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
MOTA ENGIL	4,31
CORT. AMORIM	3,78
SONAE CAP.	1,90
ALTRI	1,50
GALP	1,37
IBERSOL	-0,42
SONAE SGPS	-0,93
CTT	-1,19
BCP	-1,44
PHAROL	-1,86



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.591,62	0,35%	3,77%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.327,20	0,87%	0,28%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.397,13	0,84%	-3,05%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.348,61	0,93%	-4,41%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.734,92	0,44%	2,30%	2.872,87	2.405,70
IBEX 35	9.658,60	0,22%	-3,84%	10.772,00	9.327,60
NIKKEI 225	22.271,77	-0,31%	-2,17%	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.