

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

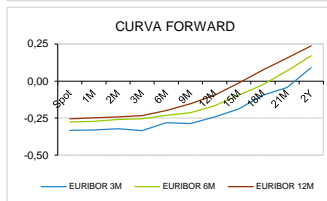
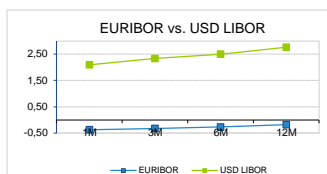
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

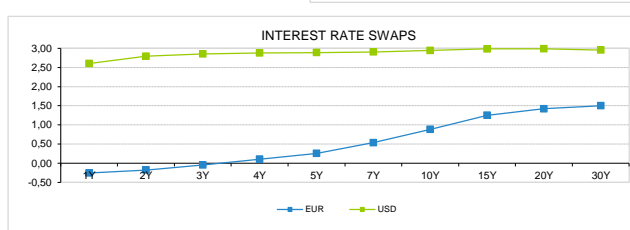
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	2,0935	-1	12	0,4999	-0,7820
3M	-0,3240	0	0	3M	2,3344	0	2	0,6641	-0,7312
6M	-0,2700	0	0	6M	2,5006	0	2	0,7848	-0,6450
12M	-0,1810	0	1	12M	2,7628	-1	3	0,9608	-0,5206

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2536	0	-2	-0,0950	0,5660	1,1215
2Y	-0,1760	0	-2	0,0716	0,7115	1,2405
3Y	-0,0450	-1	-5	0,2360	0,8582	1,3485
4Y	0,1070	-1	-7	0,3905	0,9730	1,4440
5Y	0,2570	-1	-9	0,5345	1,0895	1,5270
7Y	0,5360	-1	-10	0,7940	1,2880	1,6643
10Y	0,8840	-1	-8	1,1000	1,4903	1,7660
15Y	1,2510	-2	-6	1,3858	1,6512	1,8270
20Y	1,4210	-2	-5	1,5056	1,6907	1,8030
30Y	1,5000	-2	-4	1,5360	1,6550	1,7240

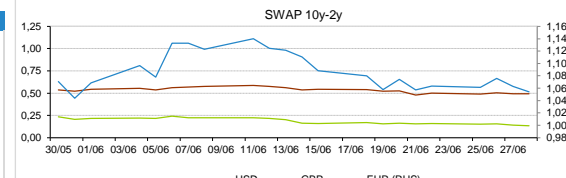
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



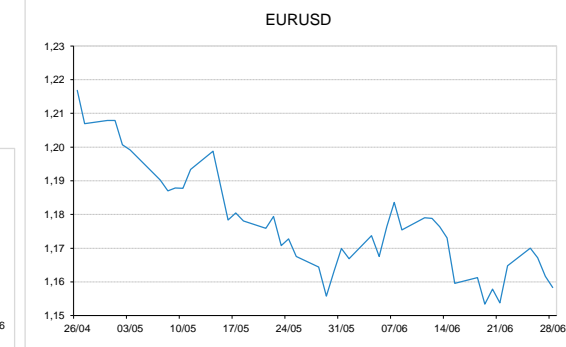
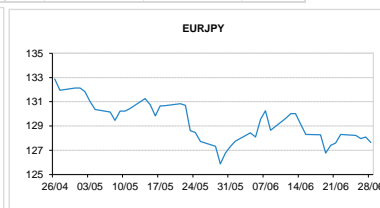
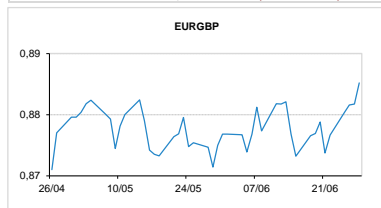
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6030	0	8	2,9641	2,9342	2,8790
2Y	2,7910	0	8	2,9657	2,8990	2,9162
3Y	2,8530	0	5	2,9350	2,8840	2,8975
4Y	2,8780	0	3	2,9045	2,9179	2,9471
5Y	2,8880	0	1	2,8990	2,8940	2,9654
7Y	2,9050	0	-1	2,9150	2,9331	2,9585
10Y	2,9410	0	-3	2,9400	2,9765	2,9982
15Y	2,9830	1	-4	2,9798	2,9736	2,9887
20Y	2,9860	1	-4	2,9720	2,9360	2,9624
30Y	2,9540	1	-4	2,9291	2,9157	2,9041



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	77,74	0,12	2,42	OT 2Y	-0,110	-0,01	-46,90
JETFUEL	709,13	-3,09	-17,87	OT 5Y	0,674	-0,01	-35,80
DIESEL	668,00	-3,09	-18,25	OT 10Y	1,833	-0,02	-36,00
COBRE	6.693,00	-20,50	-192,50	BUND 10Y	-0,176	-0,44	2,90
ZINCO	2.900,00	39,25	-151,00	SCHATZ 2Y	-0,044	0,23	8,40
OURO	1.250,28	-4,22	-47,89	T-NOTE 10Y	3,575	1,67	7,50
TRIGO	485,75	-2,75	-74,00	T-NOTE 2Y	2,922	1,95	19,90
LICENÇA C02	14,98	-0,28	-1,33	GILT 10Y	1,496	1,53	2,00


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1583	-0,28%	-0,52%	1,1664	1,1755	1,1940
EUR/GBP	0,8852	-0,39%	-1,19%	0,8877	0,8905	0,8964
EUR/JPY	127,63	0,35%	-0,24%	127,63	127,63	127,63
EUR/CHF	1,1555	-0,13%	-0,02%	1,1543	1,1529	1,1507
EUR/BRL	4,4662	-0,13%	-2,70%	4,5362	4,6052	4,7474
EUR/PLN	4,3680	-0,44%	-1,52%	4,3922	4,4162	4,4643

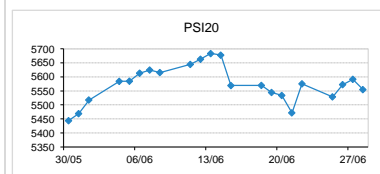

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1583	0,8852	127,63	1,1555	10,4341	7,4517	1,5353	1,57506	4,4662	9,4840
USD	0,8636	-	0,7637	110,355	0,9977	9,0104	6,4345	1,3262	1,3612	3,8399	8,1889

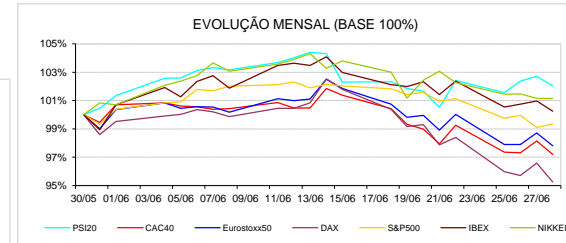
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,780	0,00	69,79
BCP	0,255	-1,70	-6,21
CORT. AMORIM	11,4200	-0,87	10,87
CTT	3,0060	0,33	-14,29
EDP	3,440	0,29	19,24
EDP R	8,845	-0,39	26,96
GALP	16,205	-0,28	5,74
IBERSOL	12,150	2,53	0,00
J MARTINS	12,760	-2,37	-21,21
MOTA ENGIL	2,910	-3,80	-20,56
NAVIGATOR	5,135	-0,87	21,68
NOS	4,710	-0,25	-14,07
NOVABASE	2,770	0,00	-9,15
PHAROL	0,237	-0,42	-5,40
REN	2,396	0,93	-3,35
SEMAPA	22,800	-0,44	28,13
SONAE CAP.	0,896	-1,75	1,01
SONAE SGPS	1,054	-1,50	-6,39

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
IBERSOL	2,53
REN	0,93
CTT	0,33
EDP	0,29
SONAE SGPS	-1,50
BCP	-1,70
SONAE CAP.	-1,75
J MARTINS	-2,37
MOTA ENGIL	-3,80



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.554,33	-0,67%	3,08%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.275,64	-0,97%	-0,69%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.365,52	-0,93%	-3,95%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.177,23	-1,39%	-5,73%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.705,95	0,24%	1,21%	2.872,87	2.405,70
IBEX 35	9.589,00	-0,72%	-4,53%	10.772,00	9.327,60
NIKKEI 225	22.270,39	-0,01%	-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.