

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

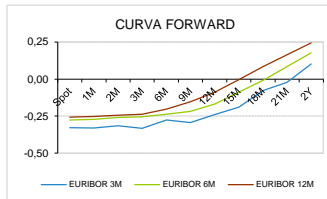
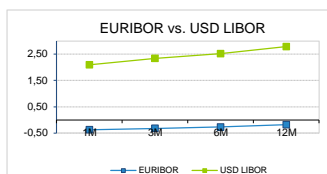
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

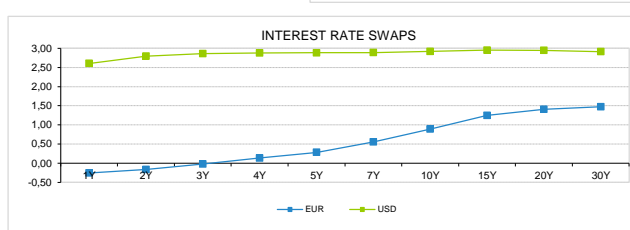
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	2,0971	1	7	0,5249	-0,7744
3M	-0,3210	0	0	3M	2,3386	0	2	0,7065	-0,7266
6M	-0,2700	0	0	6M	2,5203	1	4	0,8270	-0,6470
12M	-0,1810	0	0	12M	2,7840	1	5	0,9964	-0,5184

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2563	0	-2	-0,0885	0,5710	1,1010
2Y	-0,1660	1	-2	0,0782	0,7085	1,2140
3Y	-0,0210	2	-3	0,2396	0,8390	1,3170
4Y	0,1350	2	-4	0,3898	0,9600	1,4120
5Y	0,2840	3	-4	0,5302	1,0710	1,4890
7Y	0,5570	3	-5	0,7797	1,2640	1,6230
10Y	0,8920	3	-5	1,0783	1,4640	1,7430
15Y	1,2460	2	-4	1,3651	1,6278	1,8110
20Y	1,4080	2	-4	1,4888	1,6707	1,7880
30Y	1,4740	2	-3	1,5213	1,6420	1,7160

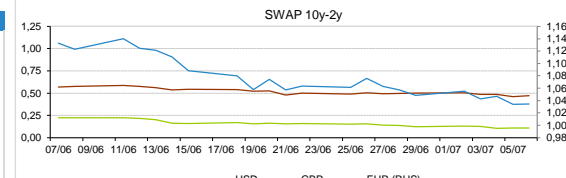
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



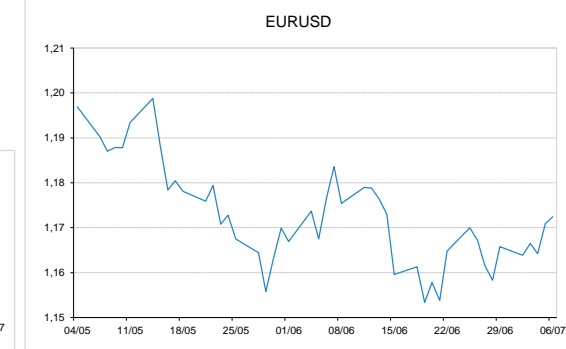
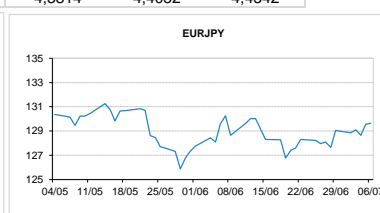
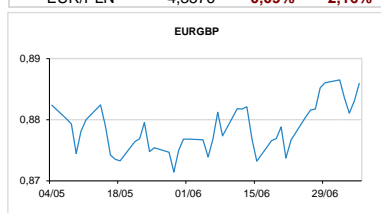
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6060	-1	6	2,9915	2,9190	2,8770
2Y	2,7940	-1	7	2,9914	2,9050	2,9003
3Y	2,8590	-1	5	2,9520	2,8630	2,8710
4Y	2,8780	-1	3	2,9105	2,9109	2,9288
5Y	2,8820	-1	1	2,9050	2,8855	2,9445
7Y	2,8900	-1	-1	2,8965	2,9110	2,9627
10Y	2,9170	-2	-3	2,9350	2,9290	2,9675
15Y	2,9490	-2	-4	2,9622	2,9534	2,9519
20Y	2,9460	-2	-5	2,9150	2,9354	2,9266
30Y	2,9130	-2	-5	2,8660	2,8460	2,8435



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	76,96	-0,43	2,00	OT 2Y	-0,090	-0,01	-9,50
JETFUEL	719,87	6,84	20,08	OT 5Y	0,641	0,00	-14,30
DIESEL	674,87	5,59	15,83	OT 10Y	1,804	0,00	-14,20
COBRE	6.324,00	-41,00	-754,00	BUND 10Y	-0,205	-0,44	-19,30
ZINCO	2.733,00	-5,75	-475,00	SCHATZ 2Y	-0,028	-0,69	-5,30
OURO	1.254,30	-3,29	-43,33	T-NOTE 10Y	3,565	-0,84	-11,30
TRIGO	504,50	-1,00	-33,00	T-NOTE 2Y	2,957	-1,17	0,00
LICENÇA C02	15,67	-0,01	-0,26	GILT 10Y	1,491	1,05	-12,70


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1724	0,13%	-0,35%	1,1805	1,1898	1,2085
EUR/GBP	0,88595	-0,32%	-1,03%	0,8885	0,8915	0,8979
EUR/JPY	129,65	-0,09%	-0,06%	129,65	129,65	129,65
EUR/CHF	1,1623	-0,06%	-0,08%	1,1611	1,1599	1,1577
EUR/BRL	4,5836	0,26%	-1,04%	4,6585	4,7287	4,8835
EUR/PLN	4,3576	-0,09%	-2,16%	4,3814	4,4052	4,4542

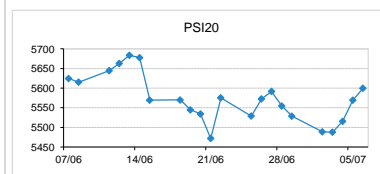

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1724	0,8860	129,65	1,1623	10,2397	7,4529	1,5370	1,58189	4,5836	9,4227
USD	0,8505	-	0,7533	110,445	0,9890	8,7228	6,3390	1,3099	1,3467	3,9279	8,0284

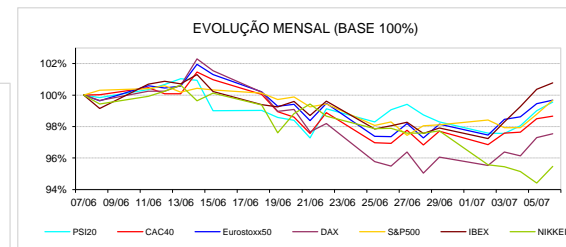
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,640	0,70	67,09
BCP	0,258	-0,92	-5,29
CORT. AMORIM	11,1800	0,36	8,54
CTT	2,9160	-0,21	-16,85
EDP	3,430	-0,72	18,89
EDP R	9,100	-0,76	30,62
GALP	16,915	0,71	10,38
IBERSOL	12,250	5,15	0,82
J MARTINS	12,570	1,91	-22,38
MOTA ENGIL	3,035	1,00	-17,14
NAVIGATOR	5,025	0,86	19,07
NOS	4,868	2,31	-11,18
NOVABASE	2,740	-0,36	-10,13
PHAROL	0,240	-0,21	-4,00
REN	2,470	0,82	-0,36
SEMAPA	23,050	2,22	29,53
SONAE CAP.	0,930	-0,64	4,85
SONAE SGPS	1,023	1,59	-9,15

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	5,15
NOS	2,31
SEMAPA	2,22
J MARTINS	1,91
SONAE SGPS	1,59
NOVABASE	-0,36
SONAE CAP.	-0,64
EDP	-0,72
EDP R	-0,76
BCP	-0,92



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.599,76	0,55%	3,92%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.375,77	0,18%	1,19%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.448,49	0,22%	-1,58%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.496,17	0,26%	-3,26%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.761,56	0,90%	3,28%	2.872,87	2.407,70
IBEX 35	9.905,00	0,39%	-1,38%	10.758,20	9.327,60
NIKKEI 225	21.788,14	1,12%	-4,29%	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.