

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

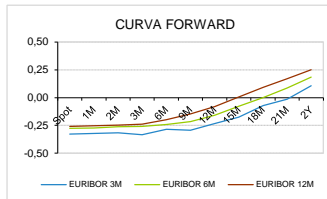
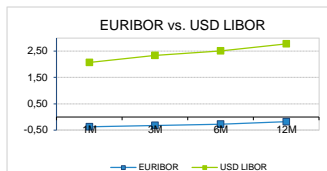
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

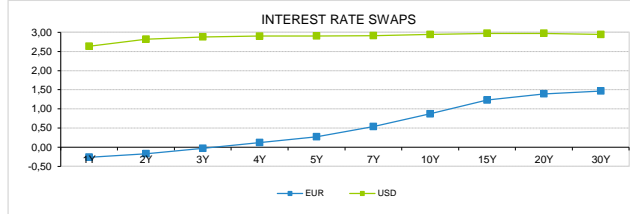
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3700	0	0	1M	2,0743	1	3	0,5483	-0,7742
3M	-0,3210	0	0	3M	2,3370	0	0	0,7226	-0,7246
6M	-0,2710	0	0	6M	2,5124	0	2	0,8365	-0,6470
12M	-0,1790	0	0	12M	2,7784	0	2	1,0023	-0,5164

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2590	0	-2	-0,0793	0,5777	1,1155
2Y	-0,1690	0	-5	0,0857	0,7205	1,2265
3Y	-0,0300	0	-8	0,2506	0,8505	1,3315
4Y	0,1230	0	-10	0,4016	0,9703	1,4261
5Y	0,2720	0	-12	0,5415	1,0824	1,5088
7Y	0,5390	0	-13	0,7917	1,2760	1,6384
10Y	0,8720	-1	-13	1,0906	1,4743	1,7616
15Y	1,2300	-1	-11	1,3776	1,6411	1,8325
20Y	1,3950	-1	-10	1,5046	1,6900	1,8119
30Y	1,4680	-1	-8	1,5441	1,6664	1,7406

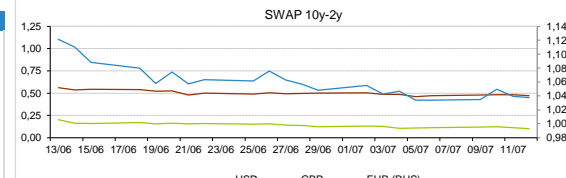
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



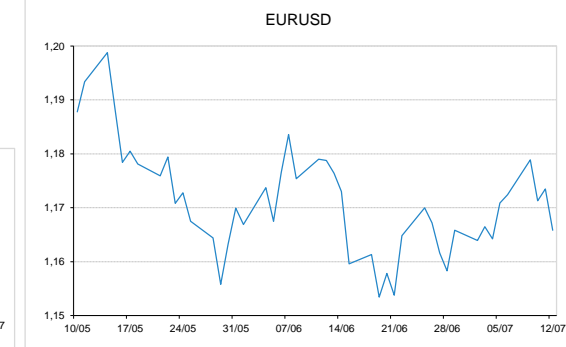
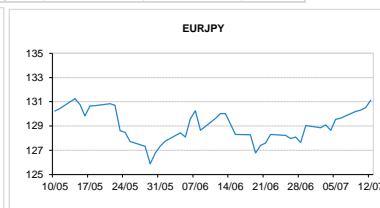
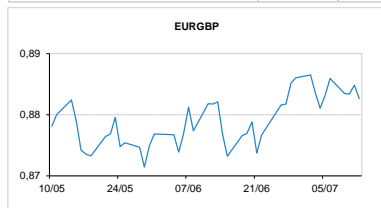
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6330	1	5	3,0136	2,8975	2,8830
2Y	2,8190	1	5	2,9999	2,8985	2,9148
3Y	2,8800	1	2	2,9445	2,8800	2,9287
4Y	2,8990	1	1	2,9390	2,8805	2,9426
5Y	2,9040	1	-1	2,9160	2,9268	2,9607
7Y	2,9140	1	-3	2,9135	2,9482	2,9802
10Y	2,9430	1	-5	2,9693	2,9395	2,9878
15Y	2,9730	1	-6	2,9790	2,9757	2,9776
20Y	2,9730	2	-7	2,9480	2,9350	2,9310
30Y	2,9410	2	-7	2,9080	2,8900	2,9022



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	73,49	0,09	-2,16	OT 2Y	-0,091	-0,01	-4,10
JETFUEL	689,25	-22,56	-24,16	OT 5Y	0,568	-0,04	-24,70
DIESEL	645,33	-22,73	-26,42	OT 10Y	1,747	-0,03	-24,00
COBRE	6.135,00	-187,50	-1.110,00	BUND 10Y	-0,205	-1,62	-21,60
ZINCO	2.587,00	-69,00	-626,00	SCHATZ 2Y	-0,014	-0,92	-4,50
OURO	1.247,52	2,33	-49,11	T-NOTE 10Y	3,587	1,34	-7,80
TRIGO	477,25	5,50	-72,75	T-NOTE 2Y	2,988	1,17	2,30
LICENÇA C02	16,09	-0,23	0,94	GILT 10Y	1,504	-1,54	-12,20


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1658	-0,66%	-1,10%	1,1738	1,1829	1,2018
EUR/GBP	0,88263	0,25%	-0,10%	0,8852	0,8882	0,8944
EUR/JPY	131,13	-0,46%	-0,84%	131,13	131,13	131,13
EUR/CHF	1,1700	-0,55%	-0,89%	1,1689	1,1676	1,1654
EUR/BRL	4,5091	0,34%	-3,10%	4,5831	4,6579	4,8194
EUR/PLN	4,3148	0,45%	-0,90%	4,3382	4,3616	4,4090

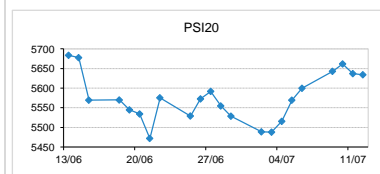

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1658	0,8826	131,13	1,1700	10,3452	7,4546	1,5389	1,57652	4,5091	9,4655
USD	0,8560	-	0,7562	112,43	1,0002	8,8624	6,3821	1,3172	1,3509	3,8595	8,1032

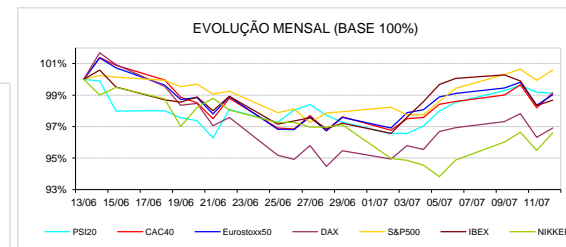
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	9,130	0,77	76,56
BCP	0,258	0,04	-5,07
CORT. AMORIM	11,3800	-0,35	10,49
CTT	2,8900	0,00	-17,59
EDP	3,501	-0,11	21,35
EDP R	9,000	-0,06	29,18
GALP	16,855	-0,91	9,98
IBERSOL	12,150	0,83	0,00
J MARTINS	12,580	-1,02	-22,32
MOTA ENGIL	3,005	-0,50	-17,96
NAVIGATOR	5,130	0,98	21,56
NOS	4,930	-0,28	-10,05
NOVABASE	2,680	-1,11	-12,10
PHAROL	0,250	3,10	-0,20
REN	2,468	0,49	-0,44
SEMAPA	22,850	0,22	28,41
SONAE CAP.	0,932	0,00	5,07
SONAE SGPS	1,018	0,49	-9,59

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
PHAROL	3,10
NAVIGATOR	0,98
IBERSOL	0,83
ALTRI	0,77
SONAE SGPS	0,49
CORT. AMORIM	-0,35
MOTA ENGIL	-0,50
GALP	-0,91
J MARTINS	-1,02
NOVABASE	-1,11



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.633,88	-0,05%	4,56%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.405,90	0,97%	1,76%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.445,49	0,68%	-1,67%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.492,97	0,61%	-3,29%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.791,72	0,64%	4,42%	2.872,87	2.417,35
IBEX 35	9.767,40	0,35%	-2,75%	10.758,20	9.327,60
NIKKEI 225	22.187,96	1,17%	-2,53%	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.