

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

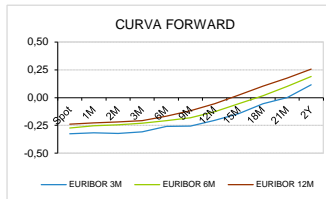
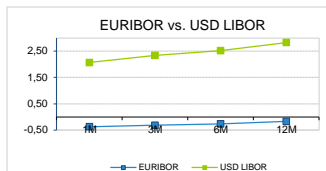
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

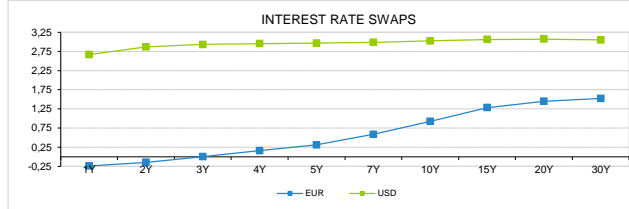
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,0673	0	-1	0,7200	-0,7764
3M	-0,3190	0	0	3M	2,3380	0	0	0,8066	-0,7236
6M	-0,2670	0	0	6M	2,5171	0	1	0,9013	-0,6490
12M	-0,1690	0	1	12M	2,8275	0	5	1,0453	-0,5138

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2393	0	2	-0,0580	0,5660	1,1055
2Y	-0,1440	0	2	0,0983	0,7055	1,2185
3Y	0,0020	-1	3	0,2540	0,8380	1,3255
4Y	0,1590	-1	4	0,4005	0,9605	1,4195
5Y	0,3090	-1	4	0,5400	1,0750	1,5025
7Y	0,5850	-1	5	0,7910	1,2670	1,6260
10Y	0,9260	0	5	1,0875	1,4713	1,7470
15Y	1,2830	1	5	1,3775	1,6395	1,8155
20Y	1,4490	1	5	1,4995	1,6807	1,7945
30Y	1,5220	2	6	1,5321	1,6505	1,7215

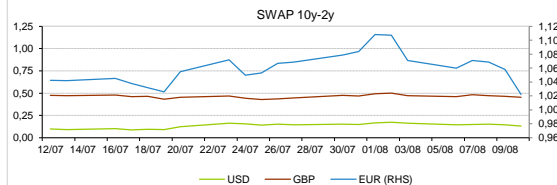
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



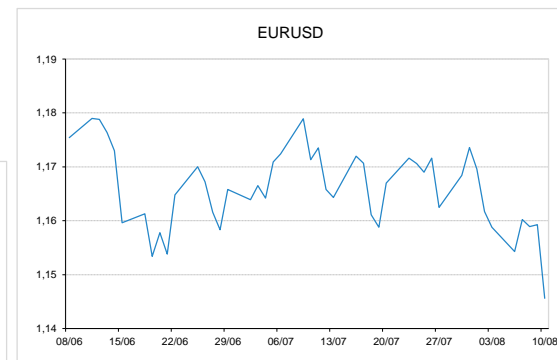
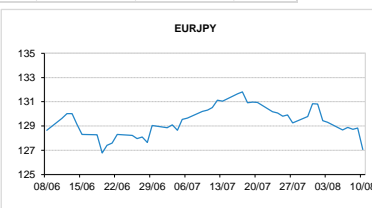
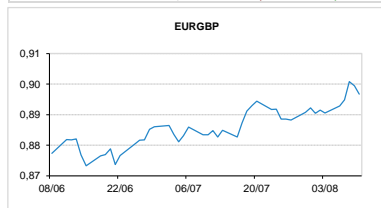
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6690	-1	5	2,9833	2,9265	2,9020
2Y	2,8690	-1	7	2,9420	2,9192	2,9155
3Y	2,9320	-1	7	2,9290	2,9000	2,9290
4Y	2,9540	-1	8	2,9165	2,9060	2,9727
5Y	2,9650	-1	9	2,9145	2,9130	2,9936
7Y	2,9860	-1	11	2,9225	2,9425	2,9935
10Y	3,0240	0	12	2,9600	2,9735	3,0070
15Y	3,0650	0	14	2,9790	2,9870	3,0005
20Y	3,0730	0	15	2,9765	2,9770	2,9840
30Y	3,0490	0	16	2,9475	2,9390	2,9330



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	72,76	0,69	-5,86	OT 2Y	-0,163	0,01	-8,50
JETFUEL	697,66	6,07	-28,67	OT 5Y	0,604	0,03	-0,20
DIESEL	660,66	7,32	-20,42	OT 10Y	1,783	0,02	1,00
COBRE	6.198,00	52,00	-165,00	BUND 10Y	-0,249	-6,26	-6,10
ZINCO	2.616,00	-8,00	-86,00	SCHATZ 2Y	-0,018	-2,06	-1,30
OURO	1.211,40	-1,47	-43,09	T-NOTE 10Y	3,579	-5,21	0,50
TRIGO	589,50	3,00	79,50	T-NOTE 2Y	2,977	-3,91	0,00
LICENÇA C02	17,87	0,27	1,82	GILT 10Y	1,456	-5,46	-6,40


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1456	-1,18%	-2,19%	1,1536	1,1627	1,1812
EUR/GBP	0,89675	0,30%	-1,49%	0,8995	0,9024	0,9085
EUR/JPY	127,07	1,39%	2,54%	127,07	127,07	127,07
EUR/CHF	1,1349	0,98%	2,63%	1,1338	1,1326	1,1303
EUR/BRL	4,3982	-0,33%	1,85%	4,4690	4,5427	4,7096
EUR/PLN	4,2892	-0,25%	0,67%	4,3126	4,3367	4,3832

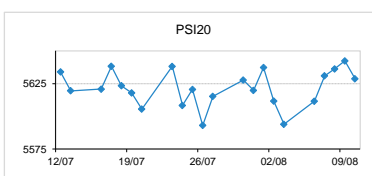

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1456	0,8968	127,07	1,1349	10,4175	7,4534	1,4966	1,56217	4,3982	9,5417
USD	0,8747	-	0,7827	110,72	0,9934	9,1054	6,5201	1,3085	1,3664	3,8406	8,3401

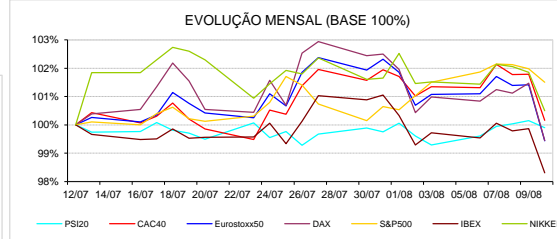
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,970	0,00	73,47
BCP	0,264	0,23	-2,94
CORT. AMORIM	10,6400	0,19	3,30
CTT	3,2240	-0,12	-8,07
EDP	3,462	-0,17	20,00
EDP R	8,765	-0,40	25,81
GALP	17,730	0,00	15,69
IBERSOL	9,720	0,83	-4,00
J MARTINS	13,040	-0,19	-19,48
MOTA ENGIL	2,890	0,17	-21,10
NAVIGATOR	4,988	-1,13	18,20
NOS	4,958	0,28	-9,54
NOVABASE	2,710	0,00	-11,12
PHAROL	0,229	0,22	-8,40
REN	2,482	-0,32	0,12
SEMAPA	19,740	-1,55	10,93
SONAE CAP.	0,872	-1,58	-1,69
SONAE SGPS	0,987	-1,20	-12,34

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	0,83
NOS	0,28
BCP	0,23
PHAROL	0,22
CORT. AMORIM	0,19
EDP R	-0,40
NAVIGATOR	-1,13
SONAE SGPS	-1,20
SEMAPA	-1,55
SONAE CAP.	-1,58



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.628,60	-0,24%	4,46%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.414,68	-1,59%	1,92%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.426,28	-1,94%	-2,22%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.424,35	-1,99%	-3,82%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.840,53	-0,46%	6,24%	2.872,87	2.417,35
IBEX 35	9.602,10	-1,56%	-4,40%	10.643,40	9.327,60
NIKKEI 225	22.298,08	-1,33%	-2,05%	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.