

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

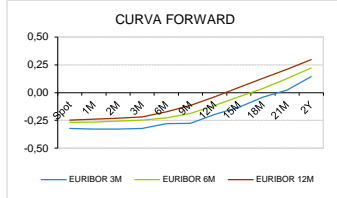
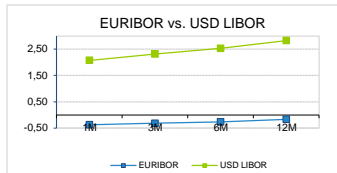
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

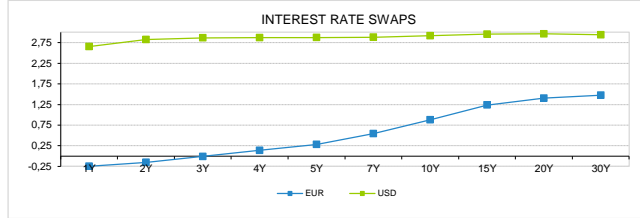
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3700	0	0	1M	2,0749	0	0	0,7230	-0,7766
3M	-0,3190	0	0	3M	2,3148	0	-3	0,8064	-0,7256
6M	-0,2660	0	0	6M	2,5283	1	0	0,8992	-0,6494
12M	-0,1650	0	1	12M	2,8281	1	1	1,0452	-0,5180

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2460	0	1	-0,0400	0,6270	1,1608
2Y	-0,1500	0	1	0,1298	0,7718	1,2744
3Y	-0,0100	0	0	0,2952	0,9001	1,3810
4Y	0,1380	0	-2	0,4504	1,0200	1,4746
5Y	0,2810	0	-3	0,5903	1,1328	1,5490
7Y	0,5450	-1	-4	0,8409	1,3252	1,6860
10Y	0,8800	0	-4	1,1394	1,5219	1,8074
15Y	1,2380	0	-3	1,4234	1,6858	1,8759
20Y	1,4040	0	-3	1,5474	1,7319	1,8540
30Y	1,4750	0	-3	1,5803	1,7053	1,7781

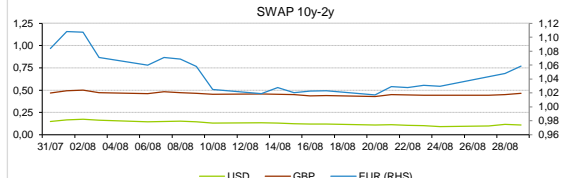
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



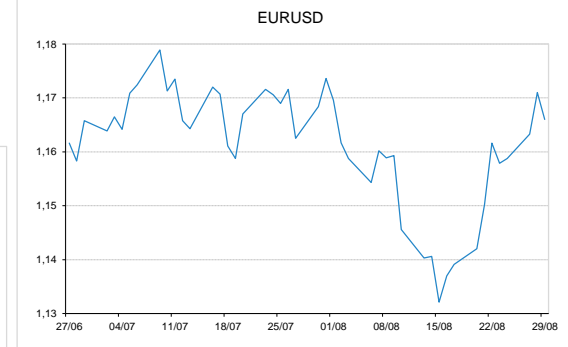
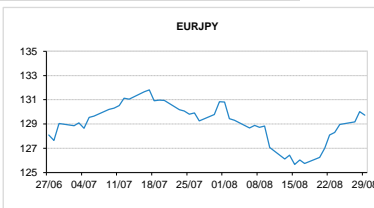
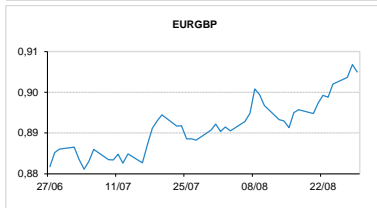
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6530	1	-2	3,0386	2,9250	2,9240
2Y	2,8230	1	-6	2,9910	2,9356	2,9185
3Y	2,8650	2	-7	2,9690	2,9220	2,9475
4Y	2,8720	2	-9	2,9620	2,9235	2,9720
5Y	2,8730	1	-10	2,9550	2,9340	3,0194
7Y	2,8820	1	-11	2,9445	2,9550	3,0085
10Y	2,9160	2	-11	3,0088	2,9975	3,0280
15Y	2,9550	2	-10	3,0050	3,0110	3,0290
20Y	2,9620	1	-10	3,0050	2,9910	3,0010
30Y	2,9380	1	-9	2,9690	2,9510	2,9569



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	76,55	0,60	1,79	OT 2Y	-0,135	0,04	4,50
JETFUEL	722,50	-0,75	11,00	OT 5Y	0,675	0,02	13,00
DIESEL	688,25	0,50	18,75	OT 10Y	1,901	0,03	12,90
COBRE	6.132,00	42,00	-150,00	BUND 10Y	-0,160	2,74	-5,30
ZINCO	2.553,00	5,00	-50,50	SCHATZ 2Y	0,030	0,46	-0,70
OURO	1.204,24	-3,59	-21,88	T-NOTE 10Y	3,601	1,01	-6,70
TRIGO	541,75	18,50	-8,25	T-NOTE 2Y	3,039	2,74	-1,20
LICENÇA C02	20,91	0,22	3,79	GILT 10Y	1,555	4,33	-0,80


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,166	-0,43%	-0,21%	1,1741	1,1834	1,2030
EUR/GBP	0,905	0,20%	-1,58%	0,9077	0,9107	0,9172
EUR/JPY	129,73	0,23%	0,05%	129,73	129,73	129,73
EUR/CHF	1,1385	0,33%	1,67%	1,1374	1,1362	1,1339
EUR/BRL	4,823	0,28%	-9,48%	4,8976	4,9799	5,1591
EUR/PLN	4,2894	-0,51%	-0,45%	4,3106	4,3327	4,3818

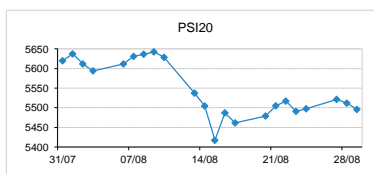

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1660	0,9050	129,73	1,1385	10,7124	7,4572	1,5151	1,60493	4,8230	9,7628
USD	0,8553	-	0,7694	111,645	0,9734	9,1609	6,3779	1,2952	1,3720	4,1317	8,3538

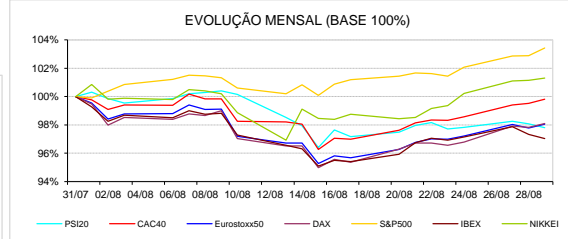
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,220	-1,08	58,96
BCP	0,255	-0,12	-6,14
CORT. AMORIM	11,1200	2,02	7,96
CTT	3,3440	0,24	-4,65
EDP	3,371	0,33	16,85
EDP R	8,615	0,12	23,65
GALP	17,820	-0,11	16,28
IBERSOL	9,680	0,00	-4,40
J MARTINS	13,215	-1,01	-18,40
MOTA ENGIL	2,860	-0,87	-21,92
NAVIGATOR	4,394	-0,99	4,12
NOS	4,930	-0,28	-10,05
NOVABASE	2,720	0,00	-10,79
PHAROL	0,211	-0,47	-15,60
REN	2,456	-0,57	-0,93
SEMAPA	18,440	-0,11	3,62
SONAE CAP.	0,885	-1,01	-0,23
SONAE SGPS	0,931	-1,64	-17,32

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	2,02
EDP	0,33
CTT	0,24
EDP R	0,12
NAVIGATOR	-0,99
SONAE CAP.	-1,01
J MARTINS	-1,01
ALTRI	-1,08
SONAE SGPS	-1,64



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.495,74	-0,29%	1,99%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.501,33	0,30%	3,55%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.456,53	0,26%	-1,35%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.561,68	0,27%	-2,76%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.912,50	0,52%	8,94%	2.915,03	2.428,20
IBEX 35	9.577,60	-0,30%	-4,64%	10.643,40	9.327,60
NIKKEI 225	22.848,22	0,15%	0,37%	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.