

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

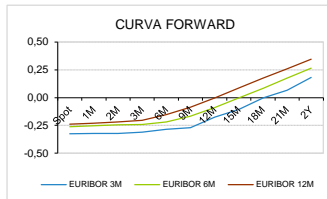
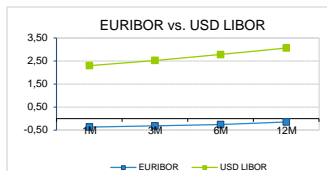
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

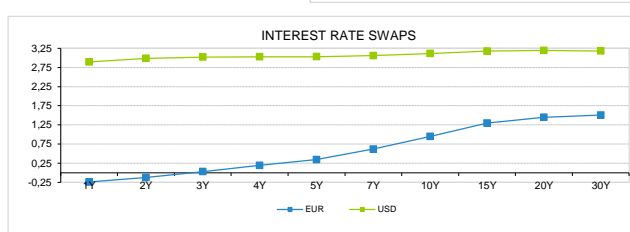
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,3020	1	4	0,7250	-0,7842
3M	-0,3180	0	0	3M	2,5266	1	13	0,8141	-0,7412
6M	-0,2590	0	1	6M	2,7818	1	18	0,9178	-0,6666
12M	-0,1490	0	1	12M	3,0638	1	15	1,0493	-0,5318

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2399	0	0	-0,0050	0,6746	1,2157
2Y	-0,1230	0	-2	0,1683	0,8141	1,3241
3Y	0,0320	0	-5	0,3372	0,9450	1,4217
4Y	0,1930	0	-6	0,4897	1,0648	1,5096
5Y	0,3450	0	-6	0,6307	1,1742	1,5861
7Y	0,6190	0	-6	0,8792	1,3589	1,7110
10Y	0,9500	0	-5	1,1687	1,5485	1,8240
15Y	1,2960	0	-3	1,4441	1,7009	1,8821
20Y	1,4500	0	-3	1,5596	1,7370	1,8504
30Y	1,5040	0	-3	1,5758	1,6898	1,7596

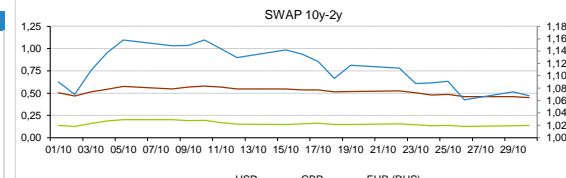
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



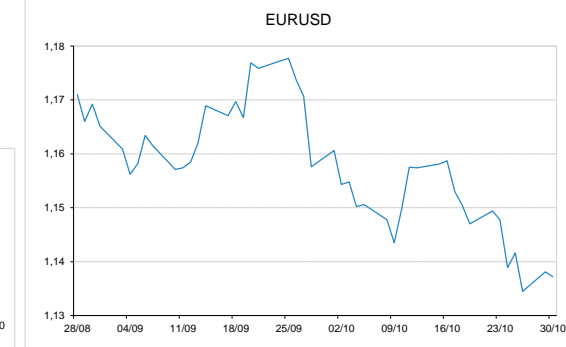
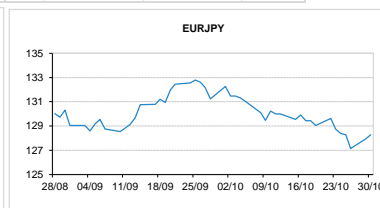
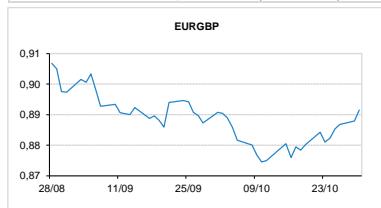
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8950	2	10	3,1778	3,0890	3,1410
2Y	2,9890	-8	-1	3,1624	3,0940	3,1655
3Y	3,0210	-9	-5	3,1300	3,1110	3,1930
4Y	3,0290	-9	-6	3,1220	3,1265	3,2160
5Y	3,0310	-9	-7	3,1270	3,1415	3,2703
7Y	3,0580	-9	-6	3,1500	3,2000	3,2850
10Y	3,1140	-8	-3	3,2060	3,2400	3,3020
15Y	3,1770	-8	0	3,2490	3,2720	3,3020
20Y	3,1940	-7	1	3,2550	3,2891	3,3069
30Y	3,1780	-7	2	3,2280	3,2270	3,2300



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	75,98	-1,36	-6,75	OT 2Y	-0,125	0,01	-4,00
JETFUEL	742,25	-11,00	-25,75	OT 5Y	0,697	0,01	-3,80
DIESEL	706,50	-10,25	-21,75	OT 10Y	1,884	0,01	0,60
COBRE	6.127,00	0,00	-98,00	BUND 10Y	-0,032	-0,60	-12,30
ZINCO	2.675,50	-23,50	29,50	SCHATZ 2Y	0,009	-0,23	-9,40
OURO	1.222,82	-3,79	30,30	T-NOTE 10Y	3,727	1,36	-0,50
TRIGO	498,75	-8,50	-10,25	T-NOTE 2Y	3,192	2,36	-1,60
LICENÇA C02	15,77	-0,91	-5,44	GILT 10Y	1,532	0,38	-18,10


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1372	-0,08%	-2,02%	1,1469	1,1561	1,1761
EUR/GBP	0,89148	-0,40%	-0,08%	0,8947	0,8978	0,9045
EUR/JPY	128,28	-0,28%	3,09%	128,28	128,28	128,28
EUR/CHF	1,1408	-0,03%	-0,22%	1,1396	1,1384	1,1362
EUR/BRL	4,2249	0,16%	10,18%	4,2942	4,3605	4,5170
EUR/PLN	4,3311	-0,15%	-1,10%	4,3561	4,3787	4,4287

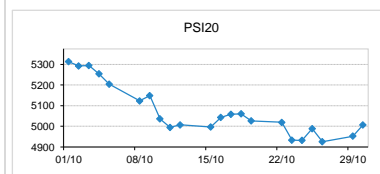

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1372	0,8915	128,28	1,1408	10,3979	7,4616	1,4921	1,59731	4,2249	9,5430
USD	0,8793	-	0,7848	112,725	1,0031	9,1447	6,5612	1,3135	1,4066	3,7065	8,3872

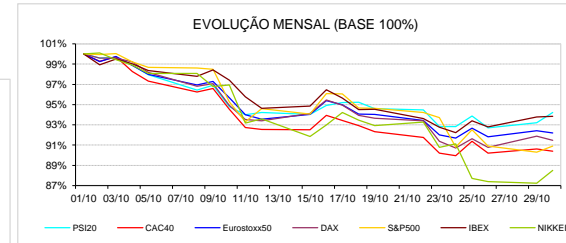
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,740	1,44	49,68
BCP	0,229	4,00	-15,81
CORT. AMORIM	9,530	-2,06	-7,48
CTT	3,330	3,22	-5,05
EDP	3,110	0,71	7,80
EDP R	7,830	-0,51	12,39
GALP	14,980	0,07	-2,25
IBERSOL	8,480	-0,47	-16,25
J MARTINS	11,515	0,92	-28,90
MOTA ENGIL	1,758	2,09	-52,01
NAVIGATOR	4,400	1,66	4,26
NOS	5,005	1,32	-8,68
NOVABASE	2,480	0,00	-18,66
PHAROL	0,148	2,21	-40,72
REN	2,330	-0,43	-6,01
SEMAPA	16,780	1,94	-5,70
SONAE CAP.	0,759	3,55	-14,43
SONAE SGPS	0,883	2,74	-21,63

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	4,00
SONAE CAP.	3,55
CTT	3,22
SONAE SGPS	2,74
PHAROL	2,21
REN	-0,43
IBERSOL	-0,47
EDP R	-0,51
CORT. AMORIM	-2,06



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.006,86	1,10%	-7,08%	5.801,45	4.893,44
CAC40	4.978,53	-0,22%	-6,29%	5.657,44	4.896,80
ESTX 50 PR	3.148,15	-0,21%	-10,15%	3.708,82	3.090,85
XTRA DAX	11.287,39	-0,42%	-12,62%	13.596,89	11.051,04
S&P 500	2.658,38	0,67%	-0,55%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.827,90	0,08%	-12,11%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	21.457,29	1,45%	-5,74%	24.448,07	20.347,49



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.