

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

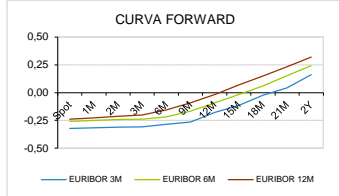
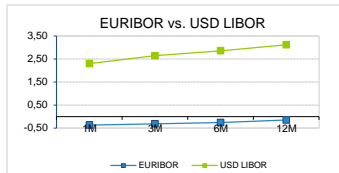
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

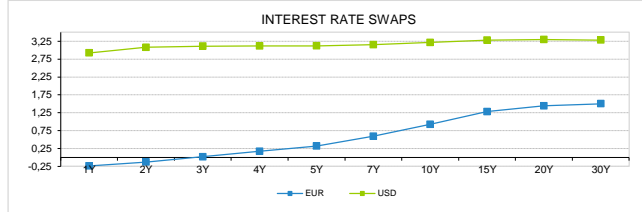
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,3025	-1	1	0,7299	-0,7850
3M	-0,3160	0	0	3M	2,6400	1	19	0,8865	-0,7452
6M	-0,2570	0	1	6M	2,8602	0	21	0,9865	-0,6668
12M	-0,1470	0	1	12M	3,1184	-1	15	1,1411	-0,5338

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2380	0	1	-0,0190	0,6420	1,1950
2Y	-0,1280	-1	-2	0,1500	0,7820	1,3070
3Y	0,0180	-2	-5	0,3120	0,9190	1,4090
4Y	0,1710	-2	-8	0,4640	1,0420	1,5000
5Y	0,3190	-3	-9	0,6080	1,1550	1,5790
7Y	0,5930	-3	-10	0,8610	1,3450	1,7040
10Y	0,9270	-3	-10	1,1580	1,5449	1,8180
15Y	1,2820	-2	-9	1,4395	1,6998	1,8760
20Y	1,4430	-1	-8	1,5566	1,7370	1,8460
30Y	1,5020	-1	-8	1,5748	1,6900	1,7550

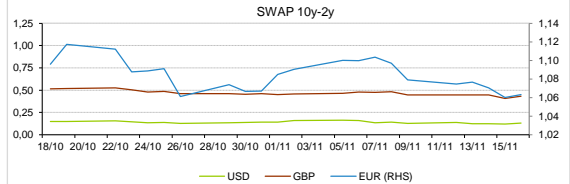
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suiza	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



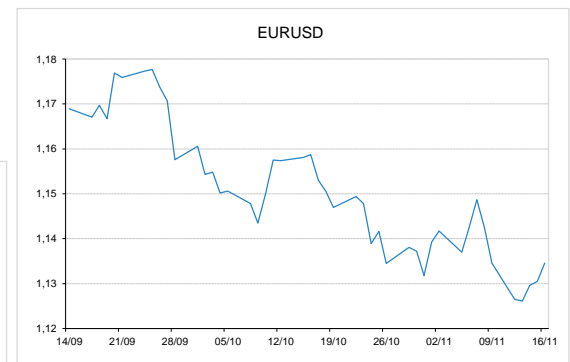
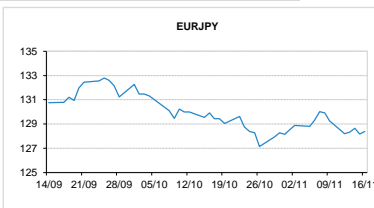
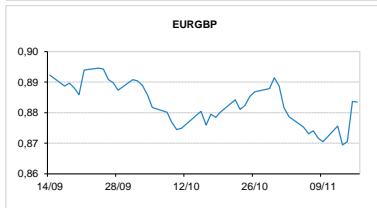
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,9260	0	10	3,1156	3,0120	3,1302
2Y	3,0800	-1	3	3,0750	3,0496	3,1400
3Y	3,1140	-1	0	3,0540	3,0550	3,1970
4Y	3,1190	-1	-1	3,0520	3,0820	3,2273
5Y	3,1220	-1	-2	3,0620	3,1120	3,2595
7Y	3,1520	-1	-1	3,1000	3,1700	3,2760
10Y	3,2140	0	0	3,1898	3,2515	3,3252
15Y	3,2800	1	2	3,2465	3,2590	3,2980
20Y	3,2980	1	3	3,2594	3,2815	3,2800
30Y	3,2830	1	5	3,2190	3,2476	3,2579



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	66,93	0,31	-14,11	OT 2Y	-0,143	0,01	-3,10
JETFUEL	681,50	0,00	-82,25	OT 5Y	0,775	0,00	-0,90
DIESEL	639,17	-5,12	-80,58	OT 10Y	1,975	0,01	2,70
COBRE	6.202,00	94,00	-117,00	BUND 10Y	-0,047	1,42	-11,00
ZINCO	2.649,50	81,50	15,00	SCHATZ 2Y	0,007	0,92	-4,30
OURO	1.221,17	7,85	-7,32	T-NOTE 10Y	3,695	-3,39	-11,80
TRIGO	513,25	-1,50	-30,25	T-NOTE 2Y	3,161	-4,32	-10,20
LICENÇA C02	19,09	0,09	-0,20	GILT 10Y	1,539	4,32	-16,10


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1346	0,36%	-2,08%	1,1443	1,1533	1,1732
EUR/GBP	0,8835	0,02%	-0,86%	0,8867	0,8897	0,8965
EUR/JPY	128,37	-0,16%	1,21%	128,37	128,37	128,37
EUR/CHF	1,1414	-0,24%	0,44%	1,1402	1,1390	1,1366
EUR/BRL	4,2748	0,41%	0,86%	4,3357	4,3981	4,5385
EUR/PLN	4,3135	-0,63%	-0,65%	4,3381	4,3611	4,4094

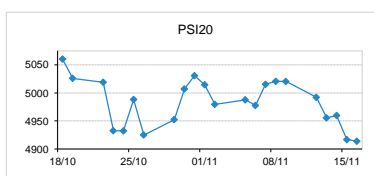

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1346	0,8835	128,37	1,1414	10,2810	7,4620	1,5006	1,55972	4,2748	9,6303
USD	0,8777	-	0,7789	112,84	1,0024	9,0186	6,5491	1,3142	1,3675	3,7491	8,4446

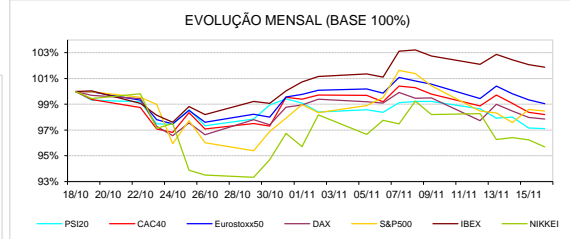
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,990	0,72	35,18
BCP	0,247	-1,40	-9,38
CORT. AMORIM	9,140	0,55	-11,26
CTT	3,386	-0,29	-3,45
EDP	3,075	0,16	6,59
EDP R	7,745	0,00	11,17
GALP	14,860	0,95	-3,03
IBERSOL	8,320	-0,48	-17,83
J MARTINS	10,650	1,19	-34,24
MOTA ENGIL	1,570	-2,61	-57,14
NAVIGATOR	3,914	-0,91	-7,25
NOS	5,085	-1,36	-7,22
NOVABASE	2,400	0,00	-21,29
PHAROL	0,173	-3,13	-30,64
REN	2,424	0,25	-2,22
SEMAPA	14,980	1,22	-15,82
SONAE CAP.	0,763	-0,26	-13,98
SONAE SGPS	0,825	0,61	-26,73

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
SEMAPA	1,22
J MARTINS	1,19
GALP	0,95
ALTRI	0,72
SONAE SGPS	0,61
NAVIGATOR	-0,91
NOS	-1,36
BCP	-1,40
MOTA ENGIL	-2,61
PHAROL	-3,13



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.913,93	-0,06%	-8,80%	5.801,45	4.893,44
CAC40	5.025,20	-0,17%	-5,41%	5.657,44	4.896,80
ESTX 50 PR	3.180,74	-0,30%	-9,22%	3.687,22	3.090,85
XTRA DAX	11.341,00	-0,11%	-12,21%	13.596,89	11.051,04
S&P 500	2.726,79	-0,13%	1,98%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	9.056,80	-0,18%	-9,83%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	21.680,34	-0,57%	-4,76%	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.