

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

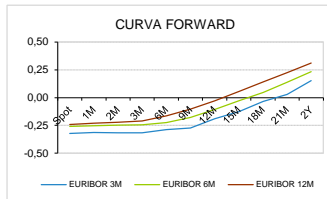
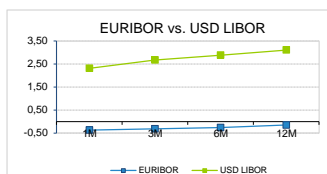
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

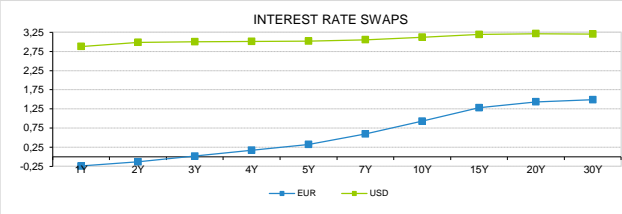
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,3151	1	3	0,7336	-0,7864
3M	-0,3160	0	0	3M	2,6769	2	20	0,8883	-0,7454
6M	-0,2570	0	0	6M	2,8859	2	16	1,0034	-0,6696
12M	-0,1480	0	0	12M	3,1104	1	9	1,1402	-0,5366

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2415	0	0	-0,0295	0,6330	1,1778
2Y	-0,1320	0	-1	0,1402	0,7773	1,2876
3Y	0,0180	0	-3	0,3031	0,9089	1,3892
4Y	0,1730	0	-4	0,4557	1,0290	1,4791
5Y	0,3230	0	-4	0,5968	1,1394	1,5520
7Y	0,5960	0	-5	0,8461	1,3264	1,6851
10Y	0,9280	0	-5	1,1392	1,5209	1,8016
15Y	1,2790	0	-5	1,4192	1,6768	1,8609
20Y	1,4350	0	-5	1,5362	1,7145	1,8234
30Y	1,4910	-1	-5	1,5525	1,6676	1,7386

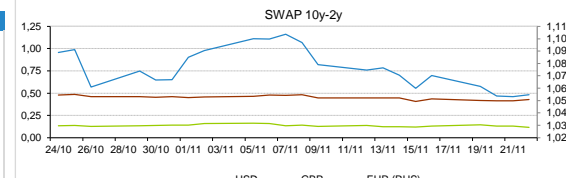
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



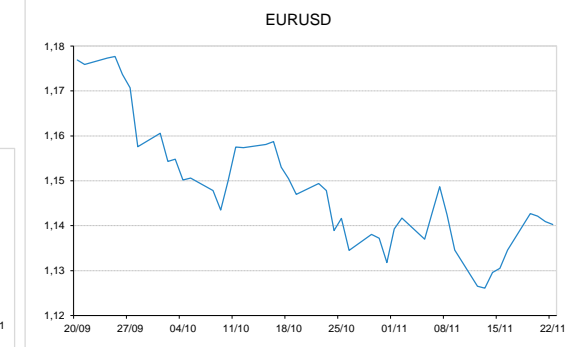
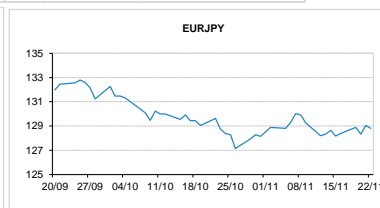
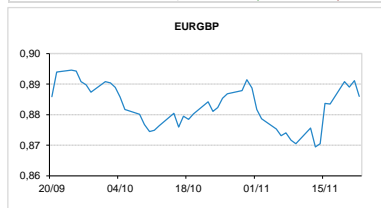
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8800	1	-1	3,0959	3,0635	3,0941
2Y	2,9870	0	-12	3,0812	3,0556	3,1463
3Y	3,0050	0	-16	3,0755	3,0680	3,1805
4Y	3,0110	0	-17	3,0688	3,0994	3,2114
5Y	3,0200	0	-17	3,0743	3,1282	3,2400
7Y	3,0550	0	-16	3,1137	3,1830	3,2770
10Y	3,1230	0	-14	3,1804	3,2343	3,3013
15Y	3,1940	-1	-12	3,2290	3,2629	3,3002
20Y	3,2150	-1	-11	3,2392	3,2598	3,2818
30Y	3,2030	-1	-9	3,2193	3,2261	3,2341



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,78	-0,70	-16,66	OT 2Y	-0,179	-0,02	-8,30
JETFUEL	642,50	-15,66	-121,25	OT 5Y	0,737	-0,02	-9,50
DIESEL	604,25	-13,00	-116,75	OT 10Y	1,950	-0,02	-5,60
COBRE	6.233,00	51,00	15,00	BUND 10Y	-0,049	-0,60	-6,60
ZINCO	2.607,50	22,50	-42,00	SCHATZ 2Y	0,016	0,23	-1,20
OURO	1.227,76	0,06	5,47	T-NOTE 10Y	3,688	0,51	-10,10
TRIGO	506,75	-1,75	-27,50	T-NOTE 2Y	3,165	0,39	-8,60
LICENÇA C02	20,97	0,48	1,97	GILT 10Y	1,543	2,88	-7,50


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1403	-0,05%	-0,79%	1,1500	1,1593	1,1789
EUR/GBP	0,88598	0,58%	-0,20%	0,8893	0,8924	0,8991
EUR/JPY	128,8	0,19%	0,64%	128,80	128,80	128,80
EUR/CHF	1,1346	-0,14%	0,75%	1,1334	1,1322	1,1297
EUR/BRL	4,3536	-0,68%	-2,94%	4,4175	4,4812	4,6291
EUR/PLN	4,2968	0,09%	-0,10%	4,3216	4,3450	4,3934

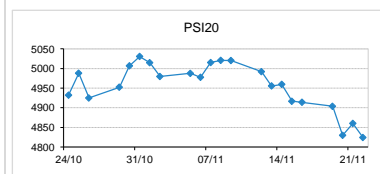

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1403	0,8860	128,80	1,1346	10,3060	7,4616	1,5059	1,57285	4,3536	9,7362
USD	0,8768	-	0,7768	112,975	0,9947	9,0330	6,5422	1,3212	1,3794	3,8135	8,5385

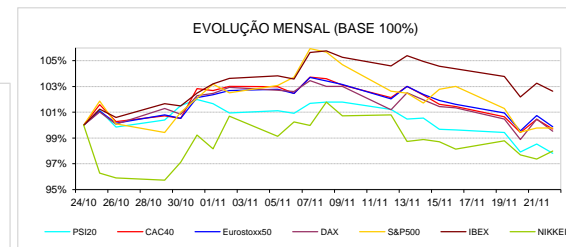
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	6,810	-2,01	31,70
BCP	0,236	-2,04	-13,42
CORT. AMORIM	9,100	0,33	-11,65
CTT	3,318	0,85	-5,39
EDP	3,041	-0,78	5,41
EDP R	7,525	-0,33	8,01
GALP	14,700	-1,21	-4,08
IBERSOL	8,160	-0,73	-19,41
J MARTINS	10,500	-1,32	-35,17
MOTA ENGIL	1,494	-3,24	-59,21
NAVIGATOR	3,772	-1,72	-10,62
NOS	5,070	0,50	-7,50
NOVABASE	2,380	-0,42	-21,94
PHAROL	0,177	0,11	-29,12
REN	2,406	0,25	-2,94
SEMAPA	14,160	-1,26	-20,43
SONAE CAP.	0,765	0,00	-13,75
SONAE SGPS	0,819	-0,79	-27,26

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	0,85
NOS	0,50
CORT. AMORIM	0,33
REN	0,25
PHAROL	0,11
J MARTINS	-1,32
NAVIGATOR	-1,72
ALTRI	-2,01
BCP	-2,04
MOTA ENGIL	-3,24



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.824,04	-0,74%	-10,47%	5.801,45	4.822,62
CAC40	4.938,16	-0,75%	-7,05%	5.657,44	4.894,30
ESTX 50 PR	3.126,75	-0,86%	-10,77%	3.687,22	3.090,85
XTRA DAX	11.139,38	-0,93%	-13,77%	13.596,89	11.009,25
S&P 500	2.649,93	0,30%	-0,89%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.905,20	-0,62%	-11,34%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	21.646,55	0,65%	-4,91%	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.