

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

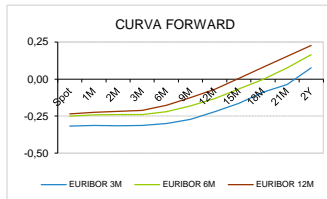
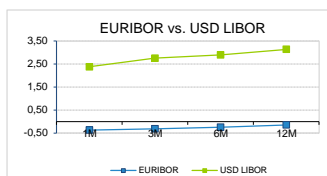
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

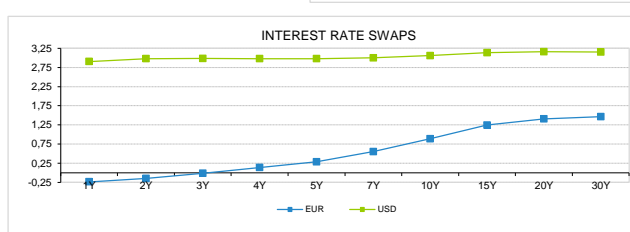
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,3789	3	6	0,7356	-0,8322
3M	-0,3160	0	0	3M	2,7513	2	16	0,8956	-0,7414
6M	-0,2470	0	1	6M	2,8953	0	7	1,0123	-0,6674
12M	-0,1420	0	1	12M	3,1382	2	3	1,1476	-0,5338

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2343	0	1	-0,0696	0,5490	1,0819
2Y	-0,1480	1	-3	0,0793	0,6843	1,1937
3Y	-0,0110	1	-6	0,2349	0,8155	1,2985
4Y	0,1380	1	-8	0,3796	0,9366	1,3922
5Y	0,2850	1	-9	0,5172	1,0487	1,4670
7Y	0,5540	1	-10	0,7652	1,2360	1,6051
10Y	0,8890	1	-9	1,0600	1,4400	1,7160
15Y	1,2450	1	-8	1,3440	1,5986	1,7760
20Y	1,4060	1	-7	1,4618	1,6384	1,7470
30Y	1,4660	1	-6	1,4826	1,5950	1,6620

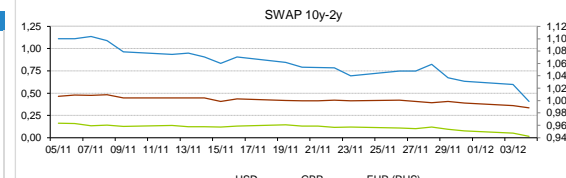
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



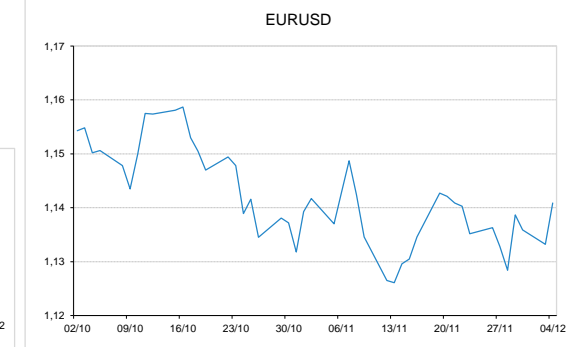
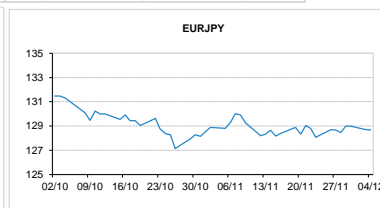
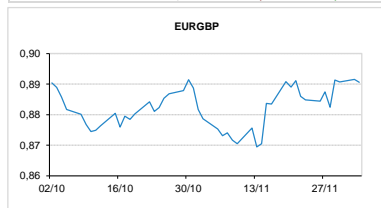
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,9060	1	3	3,0384	2,8785	2,9210
2Y	2,9790	1	-6	2,9840	2,8805	2,9465
3Y	2,9840	1	-9	2,9495	2,8940	2,9730
4Y	2,9790	1	-10	2,9340	2,9110	3,0050
5Y	2,9780	1	-11	2,9300	2,9340	3,0612
7Y	3,0000	0	-11	2,9495	2,9890	3,0870
10Y	3,0570	0	-11	3,0095	3,0520	3,1160
15Y	3,1330	0	-10	3,0630	3,0850	3,1230
20Y	3,1580	0	-9	3,0750	3,0850	3,1070
30Y	3,1510	0	-9	3,0500	3,0550	3,0630



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,20	0,51	-10,63	OT 2Y	-0,276	-0,04	-13,80
JETFUEL	624,64	23,33	-91,90	OT 5Y	0,581	0,00	-11,00
DIESEL	582,89	21,08	-92,65	OT 10Y	1,809	0,01	-7,50
COBRE	6.250,00	97,00	12,00	BUND 10Y	-0,157	-4,45	-18,50
ZINCO	2.640,50	45,50	72,00	SCHATZ 2Y	-0,016	-1,15	-3,20
OURO	1.238,30	5,22	6,10	T-NOTE 10Y	3,611	-3,37	-23,10
TRIGO	520,00	-1,25	-4,00	T-NOTE 2Y	3,153	-1,96	-15,30
LICENÇA C02	20,64	0,01	3,56	GILT 10Y	1,493	-2,30	-21,20


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1409	0,68%	0,34%	1,1502	1,1596	1,1792
EUR/GBP	0,89058	0,10%	-1,71%	0,8935	0,8967	0,9035
EUR/JPY	128,68	0,02%	0,10%	128,68	128,68	128,68
EUR/CHF	1,1319	0,12%	1,16%	1,1307	1,1295	1,1272
EUR/BRL	4,3486	0,28%	-2,07%	4,4082	4,4778	4,6287
EUR/PLN	4,2782	-0,04%	0,65%	4,3024	4,3263	4,3745

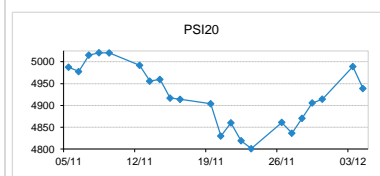

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1409	0,8906	128,68	1,1319	10,2194	7,4630	1,4987	1,54363	4,3486	9,6380
USD	0,8809	-	0,7857	113,005	0,9973	9,0021	6,5735	1,3207	1,3595	3,8283	8,4916

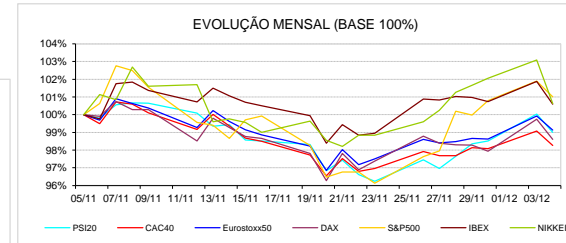
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,570	-1,94	27,05
BCP	0,248	-2,94	-9,01
CORT. AMORIM	9,560	0,74	-7,18
CTT	3,502	-1,13	-0,14
EDP	3,110	-0,03	7,80
EDP R	7,805	0,00	12,03
GALP	14,860	-1,33	-3,03
IBERSOL	8,140	0,49	-19,60
J MARTINS	10,600	0,14	-34,55
MOTA ENGIL	1,722	-1,60	-52,99
NAVIGATOR	3,702	-3,69	-12,28
NOS	5,475	-0,18	-0,11
NOVABASE	2,410	0,42	-20,96
PHAROL	0,184	-0,97	-26,32
REN	2,408	0,50	-2,86
SEMAPA	13,820	-3,36	-22,34
SONAE CAP.	0,815	0,74	-8,12
SONAE SGPS	0,823	-1,73	-26,95

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
SONAE CAP.	0,74
CORT. AMORIM	0,74
REN	0,50
IBERSOL	0,49
NOVABASE	0,42
SONAE SGPS	-1,73
ALTRI	-1,94
BCP	-2,94
SEMAPA	-3,36
NAVIGATOR	-3,69



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.938,51	-1,01%	-8,35%	5.801,45	4.783,34
CAC40	5.012,66	-0,82%	-5,65%	5.657,44	4.894,30
ESTX 50 PR	3.189,29	-0,80%	-8,98%	3.687,22	3.090,85
XTRA DAX	11.335,32	-1,14%	-12,25%	13.596,89	11.009,25
S&P 500	2.766,63	-0,87%	3,46%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	9.064,30	-1,26%	-9,75%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	22.036,05	-2,39%	-3,20%	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.