

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

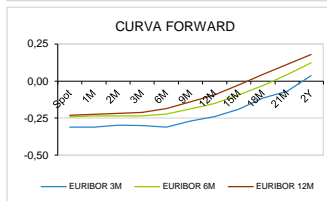
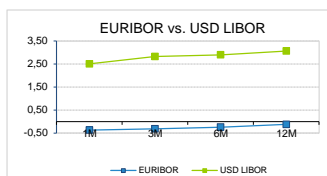
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

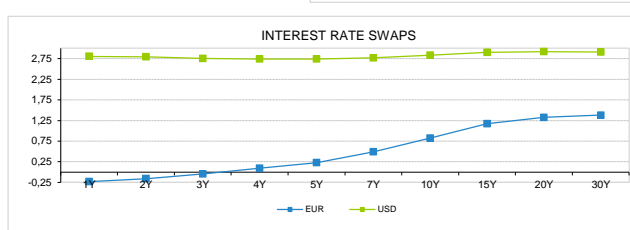
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3660	0	0	1M	2,5038	2	20	0,7293	-0,8370
3M	-0,3100	0	1	3M	2,8238	3	17	0,9084	-0,7392
6M	-0,2380	0	2	6M	2,9000	3	4	1,0329	-0,6616
12M	-0,1190	0	3	12M	3,0654	1	-3	1,1628	-0,5278

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2316	0	1	-0,0921	0,4997	1,0752
2Y	-0,1600	0	-3	0,0436	0,6458	1,1919
3Y	-0,0450	-1	-6	0,1951	0,7875	1,3007
4Y	0,0920	-2	-8	0,3432	0,9163	1,3965
5Y	0,2300	-2	-9	0,4874	1,0344	1,4720
7Y	0,4900	-3	-11	0,7460	1,2338	1,6045
10Y	0,8230	-2	-10	1,0496	1,4300	1,7188
15Y	1,1720	-2	-11	1,3285	1,5846	1,7726
20Y	1,3250	-2	-11	1,4437	1,6205	1,7368
30Y	1,3780	-2	-12	1,4619	1,5775	1,6475

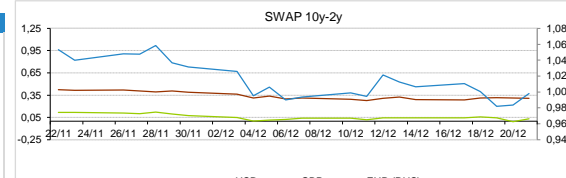
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



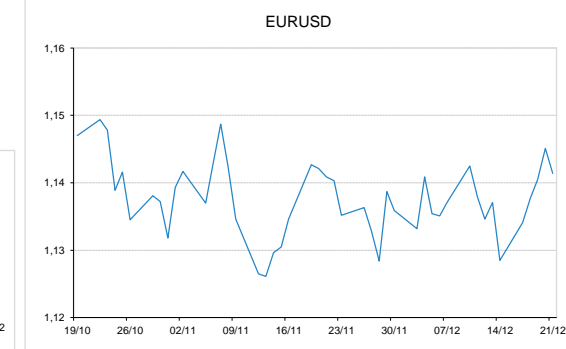
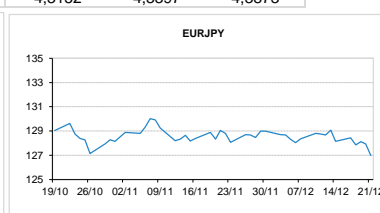
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8040	-1	-7	2,7864	2,6570	2,7950
2Y	2,7930	-1	-19	2,6999	2,7035	2,8487
3Y	2,7530	-2	-25	2,6830	2,7320	2,8600
4Y	2,7400	-2	-27	2,6980	2,7475	2,8930
5Y	2,7400	-2	-28	2,7150	2,7790	2,9477
7Y	2,7680	-3	-29	2,7530	2,8765	2,9355
10Y	2,8340	-3	-29	2,8415	2,8940	3,0104
15Y	2,9010	-4	-30	2,8845	2,9260	2,9640
20Y	2,9200	-4	-30	2,8960	2,9225	2,9430
30Y	2,9080	-4	-30	2,8795	2,8920	2,8975



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	54,22	-0,13	-9,61	OT 2Y	-0,339	0,02	-18,20
JETFUEL	559,18	-6,82	-98,98	OT 5Y	0,413	0,02	-34,70
DIESEL	520,18	-5,32	-97,07	OT 10Y	1,686	0,03	-27,90
COBRE	6.017,50	-15,00	-184,00	BUND 10Y	-0,247	1,68	-14,30
ZINCO	2.550,00	-4,50	-14,00	SCHATZ 2Y	0,046	-1,15	-2,10
OURO	1.257,74	-4,93	30,05	T-NOTE 10Y	3,497	1,00	-20,30
TRIGO	516,00	-7,50	9,25	T-NOTE 2Y	2,977	-0,78	-19,20
LICENÇA C02	24,67	0,20	3,80	GILT 10Y	1,533	4,89	-6,00


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1414	-0,32%	0,04%	1,1504	1,1598	1,1788
EUR/GBP	0,90215	0,13%	-1,23%	0,9051	0,9084	0,9155
EUR/JPY	126,98	0,76%	1,62%	126,98	126,98	126,98
EUR/CHF	1,1308	0,24%	0,21%	1,1295	1,1284	1,1262
EUR/BRL	4,4148	-0,11%	-2,05%	4,4747	4,5431	4,6866
EUR/PLN	4,2915	-0,13%	0,22%	4,3152	4,3397	4,3873

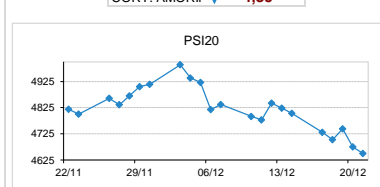

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1414	0,9022	126,98	1,1308	10,2877	7,4664	1,5462	1,61104	4,4148	9,9690
USD	0,8766	-	0,7889	111,195	0,9911	9,0033	6,5446	1,3551	1,4113	3,8740	8,7333

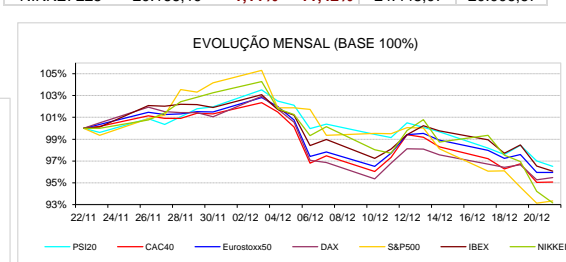
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	5,550	-0,54	7,33
BCP	0,228	-2,18	-16,03
CORT. AMORIM	8,490	-4,39	-16,80
CTT	2,952	-2,38	-15,83
EDP	3,010	1,01	4,33
EDP R	7,475	-2,35	7,29
GALP	13,455	-0,81	-12,20
IBERSOL	7,980	-0,25	-21,19
J MARTINS	10,175	0,69	-37,17
MOTA ENGIL	1,524	-1,30	-58,39
NAVIGATOR	3,526	2,08	-16,45
NOS	5,175	-0,10	-5,58
NOVABASE	2,140	-2,28	-29,81
PHAROL	0,173	-1,14	-30,80
REN	2,440	0,25	-1,57
SEMAPA	12,760	0,00	-28,29
SONAE CAP.	0,868	-0,91	-2,14
SONAE SGPS	0,799	-1,05	-29,04

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NAVIGATOR	2,08
EDP	1,01
J MARTINS	0,69
REN	0,25
BCP	-2,18
NOVABASE	-2,28
EDP R	-2,35
CTT	-2,38
CORT. AMORIM	-4,39



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.649,97	-0,53%	-13,70%	5.801,45	4.603,88
CAC40	4.694,38	0,04%	-11,64%	5.657,44	4.628,24
ESTX 50 PR	3.000,61	0,01%	-14,37%	3.687,22	2.957,56
XTRA DAX	10.633,82	0,21%	-17,68%	13.596,89	10.512,64
S&P 500	2.472,58	0,25%	-7,48%	2.940,91	2.441,18
IBEX 35	8.556,80	-0,46%	-14,81%	10.643,40	8.468,60
NIKKEI 225	20.166,19	-1,11%	-11,42%	24.448,07	20.006,67



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.