

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

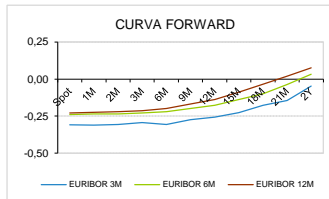
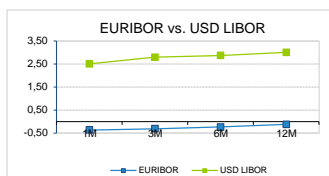
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

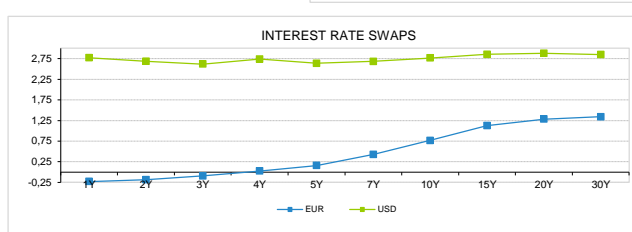
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3630	0	1	1M	2,5071	0	16	0,7301	-0,7846
3M	-0,3090	0	1	3M	2,7939	-1	6	0,9099	-0,7118
6M	-0,2370	0	1	6M	2,8739	0	-2	1,0313	-0,6318
12M	-0,1190	0	2	12M	3,0020	0	-12	1,1693	-0,5008

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2286	0	1	-0,1390	0,3707	0,9460
2Y	-0,1840	-1	-3	-0,0308	0,5200	1,0670
3Y	-0,0950	-3	-7	0,1025	0,6615	1,1775
4Y	0,0270	-4	-10	0,2445	0,7910	1,2819
5Y	0,1600	-4	-12	0,3834	0,9105	1,3650
7Y	0,4250	-5	-12	0,6390	1,1207	1,5075
10Y	0,7660	-5	-12	0,9475	1,3314	1,6312
15Y	1,1240	-5	-12	1,2416	1,4972	1,6925
20Y	1,2840	-4	-11	1,3631	1,5397	1,6621
30Y	1,3400	-4	-12	1,3862	1,4988	1,5783

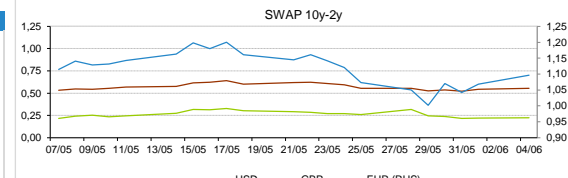
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



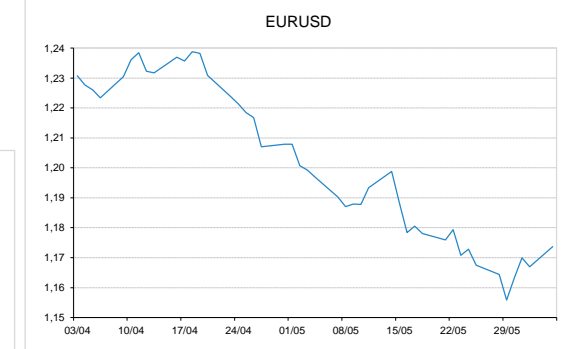
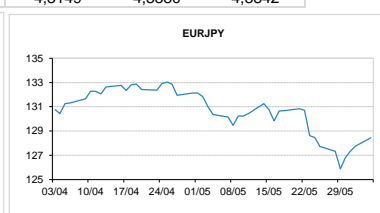
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7700	1	-14	2,5776	2,3440	2,5440
2Y	2,6830	1	-30	2,3660	2,3920	2,6010
3Y	2,6180	-1	-37	2,3831	2,4405	2,6465
4Y	2,7390	0	-27	2,3785	2,4920	2,6890
5Y	2,6350	-2	-40	2,4100	2,5400	2,7495
7Y	2,6810	-1	-37	2,4880	2,6210	2,7750
10Y	2,7660	1	-35	2,5930	2,7025	2,8080
15Y	2,8520	2	-33	2,7013	2,7700	2,8090
20Y	2,8780	2	-32	2,7282	2,7500	2,7950
30Y	2,8490	-3	-30	2,7090	2,7390	2,7640



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	55,24	0,33	-6,58	OT 2Y	-0,281	0,07	17,90
JETFUEL	561,19	3,39	-40,12	OT 5Y	0,511	0,06	8,70
DIESEL	520,44	2,89	-41,37	OT 10Y	1,767	0,05	14,70
COBRE	5.872,50	-123,00	-356,50	BUND 10Y	-0,360	-1,74	-17,20
ZINCO	2.432,00	-50,50	-133,00	SCHATZ 2Y	0,011	-0,46	-9,80
OURO	1.289,96	5,81	56,88	T-NOTE 10Y	3,291	-7,69	-5,10
TRIGO	510,75	4,00	-10,50	T-NOTE 2Y	2,747	-8,17	-7,50
LICENÇA C02	23,34	-1,97	2,35	GILT 10Y	1,415	-2,57	-11,20


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1348	-0,43%	0,14%	1,1437	1,1527	1,1705
EUR/GBP	0,90312	-0,16%	-1,29%	0,9062	0,9093	0,9159
EUR/JPY	122,21	1,69%	5,31%	122,21	122,21	122,21
EUR/CHF	1,1274	-0,43%	0,52%	1,1264	1,1251	1,1227
EUR/BRL	4,2757	0,57%	2,07%	4,3403	4,4070	4,5423
EUR/PLN	4,2912	0,04%	-0,34%	4,3149	4,3380	4,3842

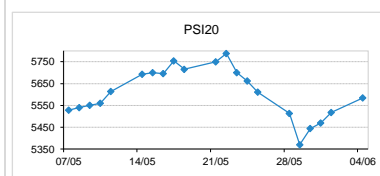

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1348	0,9031	122,21	1,1274	10,2611	7,4673	1,5371	1,62496	4,2757	9,9089
USD	0,8779	-	0,7937	107,585	0,9893	9,0190	6,5556	1,3512	1,4295	3,7587	8,7264

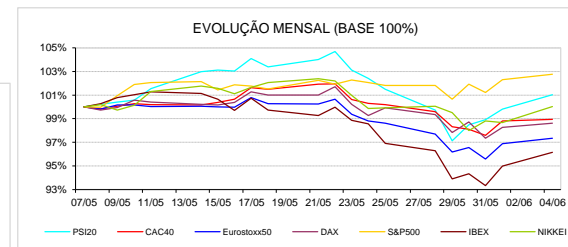
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	5,850	-1,68	0,86
BCP	0,231	0,92	0,52
CORT. AMORIM	8,850	-2,21	-1,67
CTT	2,954	-0,34	0,27
EDP	3,025	0,83	-0,79
EDP R	7,835	0,32	0,77
GALP	13,965	-0,68	1,23
IBERSOL	8,080	1,00	2,28
J MARTINS	10,300	0,00	-0,39
MOTA ENGIL	1,558	-3,47	-3,23
NAVIGATOR	3,584	-1,48	-0,44
NOS	5,345	1,14	0,94
NOVABASE	2,070	0,49	2,48
PHAROL	0,167	0,60	2,33
REN	2,490	1,72	2,30
SEMAPA	12,760	-1,39	-2,60
SONAE CAP.	0,870	0,35	2,47
SONAE SGPS	0,813	0,00	0,31

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
REN	1,72
NOS	1,14
IBERSOL	1,00
BCP	0,92
EDP	0,83
SEMAPA	-1,39
NAVIGATOR	-1,48
ALTRI	-1,68
CORT. AMORIM	-2,21
MOTA ENGIL	-3,47



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.746,06	0,11%	0,31%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.611,48	-1,66%	-2,52%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	2.954,66	-1,29%	-1,56%	3.687,22	2.908,70
XTRA DAX	10.416,66	-1,55%	-1,35%	13.596,89	10.279,20
S&P 500	2.481,84	-1,03%	-0,90%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	8.523,30	-0,31%	-0,19%	10.643,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.014,77	-0,31%	0,00%	24.448,07	18.948,58



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.