

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

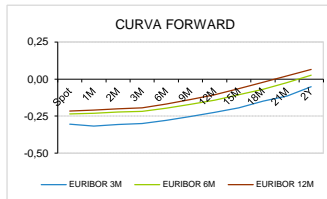
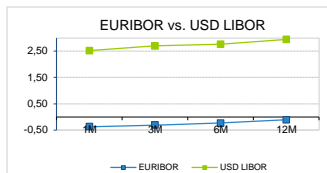
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

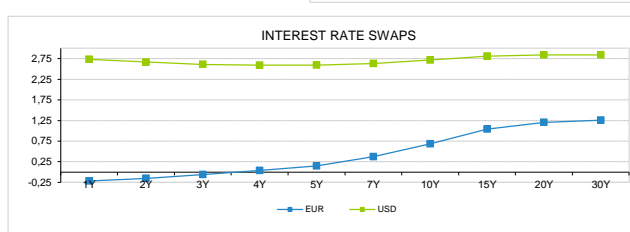
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	-1	1M	2,5169	0	1	0,7316	-0,7794
3M	-0,3080	0	0	3M	2,6970	-4	-10	0,8969	-0,7114
6M	-0,2330	0	0	6M	2,7650	-1	-8	1,0149	-0,6528
12M	-0,1090	0	1	12M	2,9483	-1	-5	1,1646	-0,5142

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2150	0	0	-0,1070	0,2740	0,7510
2Y	-0,1500	0	2	-0,0199	0,3886	0,8703
3Y	-0,0610	0	1	0,0767	0,5090	0,9835
4Y	0,0400	0	-1	0,1829	0,6270	1,0858
5Y	0,1480	0	-3	0,2958	0,7415	1,1660
7Y	0,3730	-1	-7	0,5214	0,9425	1,3189
10Y	0,6860	-1	-9	0,8125	1,1607	1,4575
15Y	1,0410	-1	-10	1,1058	1,3418	1,5381
20Y	1,2040	-1	-10	1,2347	1,3965	1,5204
30Y	1,2590	-1	-10	1,2635	1,3618	1,4297

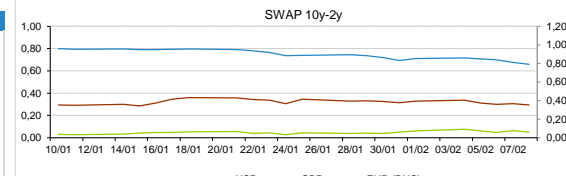
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



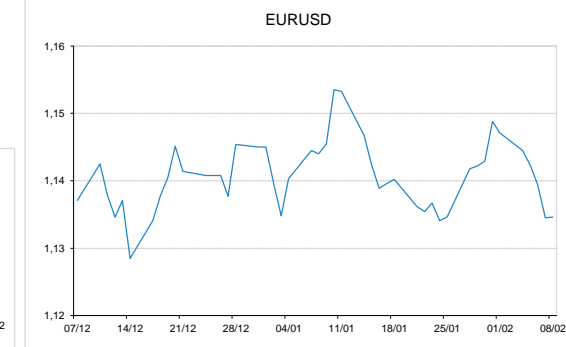
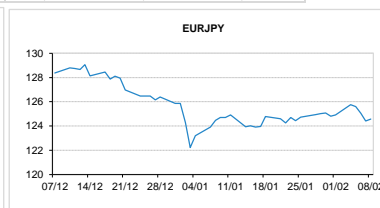
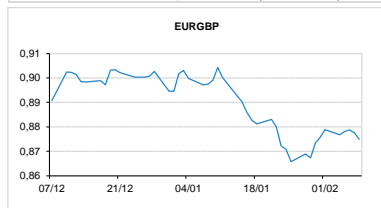
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7320	1	-3	2,5354	2,4275	2,6205
2Y	2,6660	-1	2	2,4425	2,4850	2,6565
3Y	2,6100	-1	4	2,4380	2,5210	2,6960
4Y	2,5880	-1	-15	2,4895	2,5918	2,7410
5Y	2,5910	-1	4	2,5202	2,6065	2,8008
7Y	2,6320	-1	3	2,5590	2,6800	2,8250
10Y	2,7150	-1	2	2,6650	2,7710	2,8710
15Y	2,8080	-1	2	2,7711	2,8080	2,8770
20Y	2,8390	-1	2	2,7760	2,8210	2,8620
30Y	2,8400	0	2	2,7760	2,8233	2,8140



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	61,50	-0,13	2,61	OT 2Y	-0,205	-0,01	-1,40
JETFUEL	613,88	3,85	21,91	OT 5Y	0,438	-0,02	-8,60
DIESEL	580,88	4,60	31,66	OT 10Y	1,649	-0,01	-12,40
COBRE	6.253,50	-33,00	323,00	BUND 10Y	-0,493	-2,58	-20,00
ZINCO	2.729,50	15,50	214,50	SCHATZ 2Y	0,041	0,00	0,20
OURO	1.314,04	3,13	27,57	T-NOTE 10Y	3,344	-1,48	-7,40
TRIGO	519,50	6,25	1,75	T-NOTE 2Y	2,813	-2,34	-8,20
LICENÇA C02	22,36	-1,12	-0,48	GILT 10Y	1,384	-2,85	-9,00


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1346	0,01%	-0,82%	1,1433	1,1522	1,1704
EUR/GBP	0,8749	0,30%	2,58%	0,8776	0,8805	0,8866
EUR/JPY	124,57	-0,13%	-0,09%	124,57	124,57	124,57
EUR/CHF	1,1327	0,34%	-0,82%	1,1317	1,1305	1,1281
EUR/BRL	4,2317	-0,30%	0,36%	4,2924	4,3578	4,4935
EUR/PLN	4,3130	-0,11%	-0,38%	4,3342	4,3564	4,4020

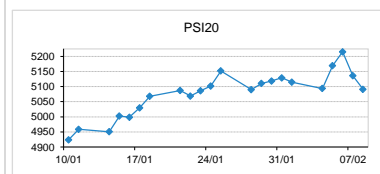

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1346	0,8749	124,57	1,1327	10,4951	7,4632	1,5038	1,59733	4,2317	9,7800
USD	0,8828	-	0,7726	109,73	1,0005	9,2685	6,5881	1,3274	1,4103	3,7294	8,6240

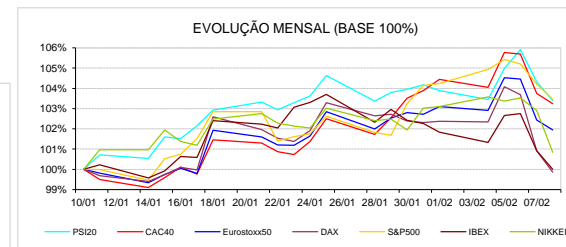
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,260	0,28	25,17
BCP	0,230	-0,78	0,26
CORT. AMORIM	9,910	0,51	10,11
CTT	3,096	-0,06	5,09
EDP	3,164	-1,40	3,77
EDP R	7,860	-0,19	1,09
GALP	13,390	-2,76	-2,94
IBERSOL	8,060	-1,23	2,03
J MARTINS	13,070	-1,10	26,40
MOTA ENGIL	1,840	-1,08	14,29
NAVIGATOR	4,188	-1,41	16,33
NOS	5,570	-0,09	5,19
NOVABASE	2,170	0,00	7,43
PHAROL	0,181	0,89	10,66
REN	2,620	-0,38	7,64
SEMAPA	14,980	0,40	14,35
SONAE CAP.	0,903	1,46	6,36
SONAE SGPS	0,904	0,00	11,60

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
SONAE CAP.	1,46
PHAROL	0,89
CORT. AMORIM	0,51
SEMAPA	0,40
ALTRI	0,28
J MARTINS	-1,10
IBERSOL	-1,23
EDP	-1,40
NAVIGATOR	-1,41
GALP	-2,76



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.091,06	-0,88%	7,60%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.961,64	-0,48%	4,88%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.135,62	-0,48%	4,47%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	10.906,78	-1,05%	3,29%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.685,93	-0,72%	7,16%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	8.856,80	-0,91%	3,71%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.333,17	-2,01%	1,59%	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.