

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

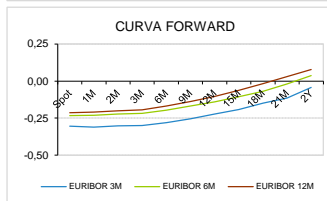
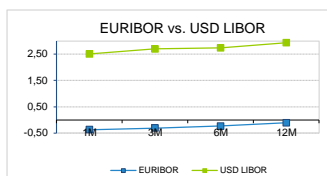
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

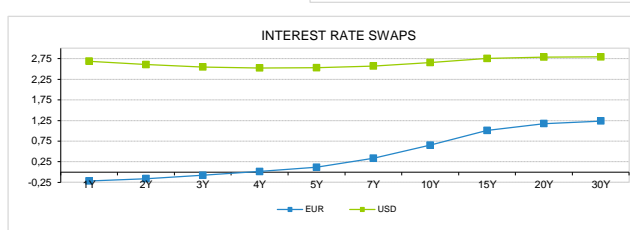
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,5041	-1	-1	0,7321	-0,7794
3M	-0,3080	0	0	3M	2,6978	0	-8	0,8828	-0,7098
6M	-0,2320	0	0	6M	2,7419	-2	-11	1,0065	-0,6534
12M	-0,1090	0	1	12M	2,9358	-1	-8	1,1418	-0,5160

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2141	0	1	-0,1056	0,2971	0,7839
2Y	-0,1590	-1	0	-0,0136	0,4147	0,9027
3Y	-0,0800	-2	-3	0,0893	0,5372	1,0170
4Y	0,0140	-3	-6	0,1995	0,6578	1,1207
5Y	0,1160	-3	-9	0,3151	0,7733	1,2090
7Y	0,3360	-4	-14	0,5453	0,9783	1,3552
10Y	0,6500	-4	-16	0,8410	1,1937	1,4918
15Y	1,0080	-3	-16	1,1342	1,3735	1,5709
20Y	1,1740	-3	-16	1,2628	1,4268	1,5511
30Y	1,2380	-2	-15	1,2899	1,3902	1,4640

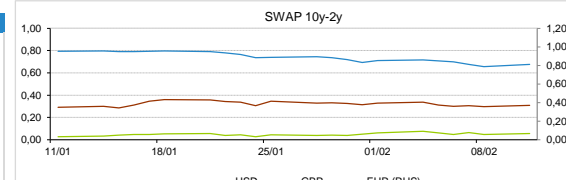
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



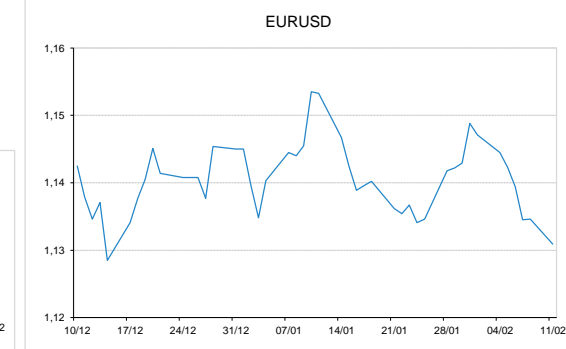
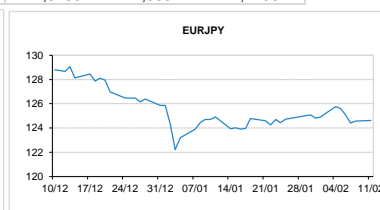
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6860	-2	-8	2,5589	2,4760	2,6759
2Y	2,6050	-2	-9	2,4790	2,5366	2,7091
3Y	2,5460	-3	-9	2,5040	2,5420	2,7235
4Y	2,5240	-3	-9	2,5010	2,6202	2,7620
5Y	2,5280	-3	-9	2,5060	2,6592	2,8220
7Y	2,5700	-3	-8	2,5925	2,7100	2,8490
10Y	2,6550	-3	-7	2,7105	2,7885	2,8830
15Y	2,7530	-3	-6	2,7700	2,8330	2,8900
20Y	2,7860	-3	-5	2,7940	2,8360	2,8750
30Y	2,7900	-3	-4	2,7910	2,8130	2,8638



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	61,32	-0,78	0,69	OT 2Y	-0,209	0,00	-2,70
JETFUEL	612,18	-1,70	-2,57	OT 5Y	0,428	-0,01	-4,60
DIESEL	580,68	-0,20	9,93	OT 10Y	1,655	0,00	-6,10
COBRE	6.201,50	-36,00	304,00	BUND 10Y	-0,462	3,29	-15,00
ZINCO	2.707,00	-22,50	211,00	SCHATZ 2Y	0,046	0,92	1,40
OURO	1.309,73	-5,29	19,44	T-NOTE 10Y	3,367	1,80	-5,10
TRIGO	512,50	-4,75	-7,00	T-NOTE 2Y	2,848	2,53	-4,70
LICENÇA C02	22,33	-0,04	-0,41	GILT 10Y	1,410	2,56	-8,90


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1309	-0,33%	-1,94%	1,1395	1,1485	1,1667
EUR/GBP	0,87615	-0,14%	2,74%	0,8788	0,8817	0,8879
EUR/JPY	124,63	-0,05%	0,22%	124,63	124,63	124,63
EUR/CHF	1,1326	0,02%	-0,38%	1,1316	1,1305	1,1281
EUR/BRL	4,249	-0,55%	0,18%	4,3090	4,3769	4,5163
EUR/PLN	4,3245	-0,30%	-0,71%	4,3459	4,3691	4,4156

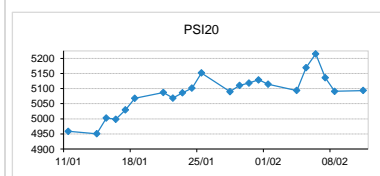

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1309	0,8762	124,63	1,1326	10,4881	7,4626	1,5000	1,59693	4,2490	9,8374
USD	0,8870	-	0,7773	110,395	1,0042	9,2999	6,6189	1,3309	1,4154	3,7652	8,7197

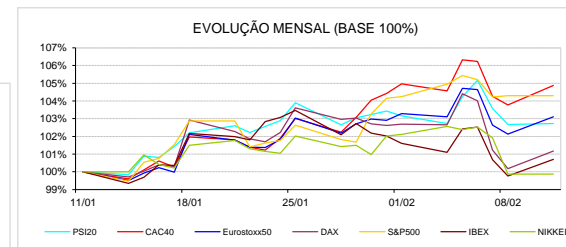
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,300	0,55	25,86
BCP	0,232	0,74	1,00
CORT. AMORIM	10,000	0,91	11,11
CTT	3,120	0,78	5,91
EDP	3,158	-0,19	3,57
EDP R	7,835	-0,32	0,77
GALP	13,585	1,46	-1,52
IBERSOL	8,280	2,73	4,81
J MARTINS	12,950	-0,92	25,24
MOTA ENGIL	1,830	-0,54	13,66
NAVIGATOR	4,182	-0,14	16,17
NOS	5,500	-1,26	3,87
NOVABASE	2,140	-1,38	5,94
PHAROL	0,181	0,44	11,15
REN	2,620	0,00	7,64
SEMAPA	14,940	-0,27	14,05
SONAE CAP.	0,901	-0,22	6,12
SONAE SGPS	0,910	0,61	12,28

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
IBERSOL	2,73
GALP	1,46
CORT. AMORIM	0,91
CTT	0,78
BCP	0,74
EDP R	-0,32
MOTA ENGIL	-0,54
J MARTINS	-0,92
NOS	-1,26
NOVABASE	-1,38



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.093,82	0,05%	7,66%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.014,47	1,06%	6,00%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.165,67	0,96%	5,47%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.014,59	0,99%	4,32%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.707,08	-0,01%	8,01%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	8.939,30	0,93%	4,68%	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.