

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

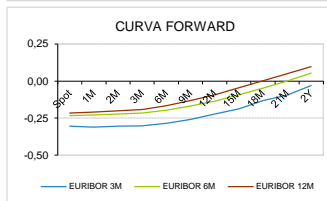
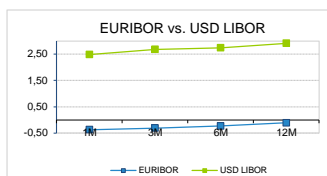
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

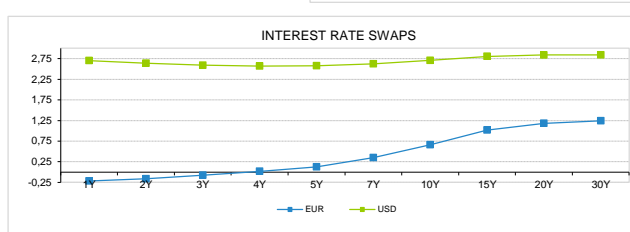
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4888	-1	-2	0,7299	-0,7748
3M	-0,3080	0	0	3M	2,6838	-1	-10	0,8696	-0,7178
6M	-0,2310	0	1	6M	2,7433	0	-12	0,9914	-0,6554
12M	-0,1080	0	1	12M	2,9158	0	-10	1,1298	-0,5128

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2149	0	1	-0,0927	0,3190	0,7770
2Y	-0,1610	0	-1	0,0024	0,4234	0,8895
3Y	-0,0770	0	-3	0,1103	0,5460	0,9995
4Y	0,0200	0	-5	0,2193	0,6565	1,1025
5Y	0,1250	0	-8	0,3297	0,7675	1,1920
7Y	0,3490	0	-12	0,5494	0,9693	1,3380
10Y	0,6630	0	-14	0,8399	1,1894	1,4750
15Y	1,0190	0	-16	1,1352	1,3711	1,5530
20Y	1,1830	0	-16	1,2576	1,4197	1,5341
30Y	1,2430	0	-16	1,2837	1,3835	1,4500

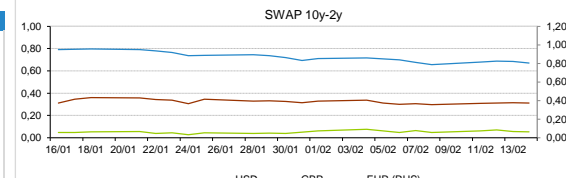
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



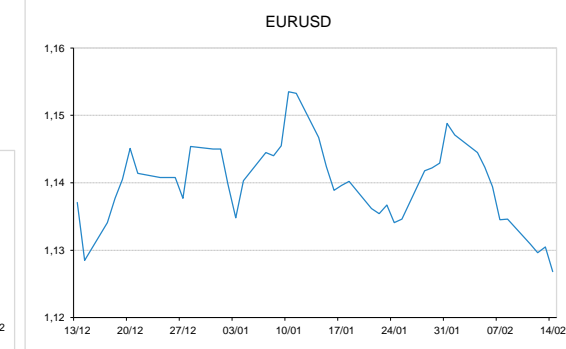
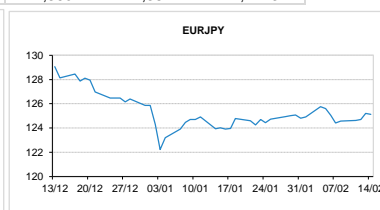
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7030	1	-6	2,5800	2,4640	2,6570
2Y	2,6390	2	-5	2,4890	2,5190	2,7040
3Y	2,5880	2	-4	2,4810	2,5640	2,7420
4Y	2,5710	2	-3	2,4980	2,6090	2,7790
5Y	2,5790	2	-2	2,5265	2,6510	2,8379
7Y	2,6220	3	-2	2,5940	2,7471	2,8680
10Y	2,7070	3	-1	2,7015	2,7925	2,9260
15Y	2,8040	3	-1	2,7735	2,8490	2,9030
20Y	2,8370	3	0	2,7995	2,8410	2,8905
30Y	2,8390	3	0	2,8090	2,8095	2,8580



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,18	0,57	5,00	OT 2Y	-0,220	0,01	-2,80
JETFUEL	630,75	2,50	18,50	OT 5Y	0,376	0,00	-5,80
DIESEL	600,50	2,00	31,25	OT 10Y	1,574	-0,02	-8,50
COBRE	6.144,00	19,00	183,00	BUND 10Y	-0,475	-2,52	-11,40
ZINCO	2.596,00	-9,50	93,00	SCHATZ 2Y	0,064	0,23	5,90
OURO	1.311,40	-0,43	19,61	T-NOTE 10Y	3,378	-3,62	-2,00
TRIGO	512,75	-13,25	-7,00	T-NOTE 2Y	2,869	-3,51	0,20
LICENÇA C02	19,83	-1,11	-2,72	GILT 10Y	1,395	-2,95	-9,90


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1268	-0,33%	-1,74%	1,1355	1,1443	1,1627
EUR/GBP	0,87945	-0,45%	1,50%	0,8821	0,8850	0,8912
EUR/JPY	125,12	0,06%	-0,95%	125,12	125,12	125,12
EUR/CHF	1,1357	0,15%	-0,92%	1,1346	1,1335	1,1311
EUR/BRL	4,2211	0,26%	0,35%	4,2822	4,3475	4,4809
EUR/PLN	4,3383	-0,04%	-1,09%	4,3601	4,3821	4,4273

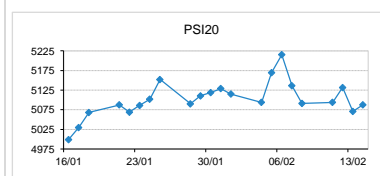

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1268	0,8795	125,12	1,1357	10,4933	7,4607	1,5015	1,5906	4,2211	9,7674
USD	0,8871	-	0,7825	110,72	1,0073	9,3142	6,6184	1,3323	1,4097	3,7625	8,6699

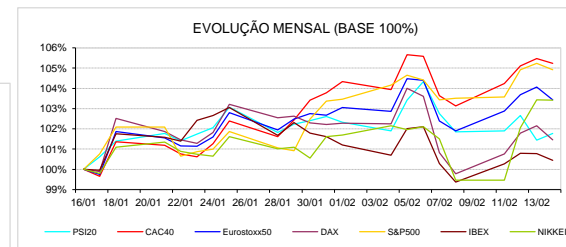
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,300	-3,69	25,86
BCP	0,227	-0,53	-1,00
CORT. AMORIM	9,620	-2,34	6,89
CTT	3,068	-0,84	4,14
EDP	3,260	2,45	6,92
EDP R	7,970	1,14	2,51
GALP	14,000	0,72	1,49
IBERSOL	7,860	-0,51	-0,51
J MARTINS	12,765	0,51	23,45
MOTA ENGIL	1,868	1,41	16,02
NAVIGATOR	4,170	0,48	15,83
NOS	5,305	0,47	0,19
NOVABASE	2,130	-2,29	5,45
PHAROL	0,180	-0,44	10,17
REN	2,602	-0,08	6,90
SEMAPA	15,080	0,00	15,11
SONAE CAP.	0,895	0,00	5,42
SONAE SGPS	0,901	-0,61	11,23

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variacao %
EDP	2,45
MOTA ENGIL	1,41
EDP R	1,14
GALP	0,72
J MARTINS	0,51
SONAE SGPS	-0,61
CTT	-0,84
NOVABASE	-2,29
CORT. AMORIM	-2,34
ALTRI	-3,69



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.087,46	0,33%	7,52%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.062,52	-0,23%	7,01%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.182,66	-0,62%	6,04%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.089,79	-0,69%	5,03%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.745,43	-0,29%	9,50%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	8.952,50	-0,33%	4,83%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.139,71	-0,02%	5,62%	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.