

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

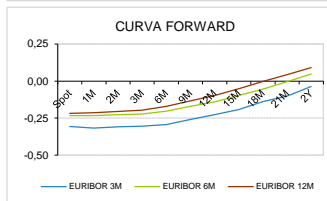
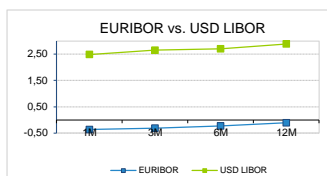
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

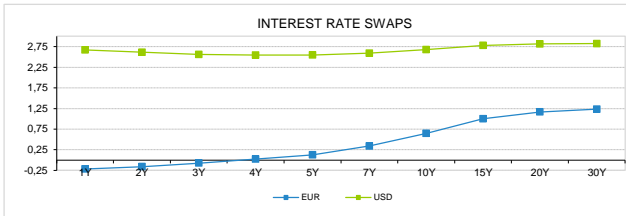
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4899	1	-2	0,7288	-0,7762
3M	-0,3100	0	0	3M	2,6510	-1	-12	0,8648	-0,7148
6M	-0,2310	0	1	6M	2,7043	1	-15	0,9949	-0,6558
12M	-0,1080	0	1	12M	2,8866	1	-15	1,1385	-0,5178

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2175	0	0	-0,0960	0,2980	0,7515
2Y	-0,1600	1	-1	-0,0024	0,4050	0,8650
3Y	-0,0730	1	-3	0,0980	0,5200	0,9735
4Y	0,0240	1	-5	0,2010	0,6345	1,0745
5Y	0,1270	1	-8	0,3105	0,7450	1,1632
7Y	0,3400	1	-12	0,5295	0,9435	1,3115
10Y	0,6460	1	-16	0,8180	1,1661	1,4505
15Y	0,9990	0	-17	1,1151	1,3518	1,5330
20Y	1,1660	0	-16	1,2423	1,4029	1,5195
30Y	1,2320	0	-16	1,2747	1,3725	1,4400

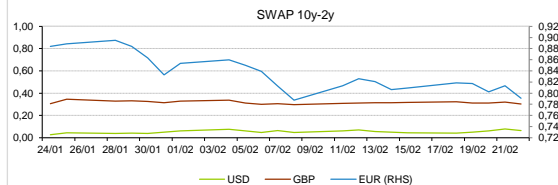
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



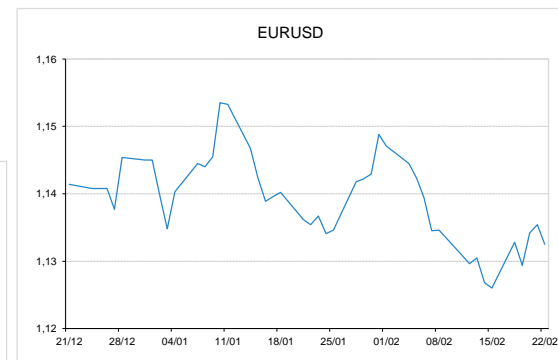
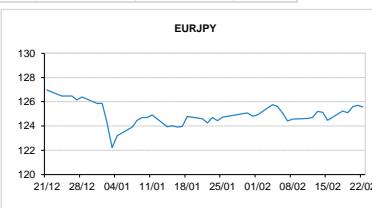
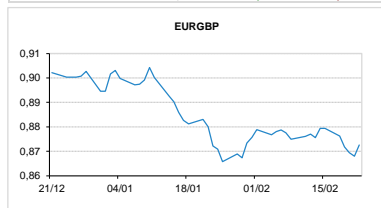
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6700	-4	-12	2,5503	2,4711	2,6190
2Y	2,6120	0	-16	2,4670	2,4880	2,6690
3Y	2,5600	0	-16	2,4610	2,5330	2,7150
4Y	2,5420	1	-16	2,4770	2,5790	2,7540
5Y	2,5460	1	-16	2,5040	2,6220	2,8134
7Y	2,5900	1	-15	2,5750	2,6990	2,8490
10Y	2,6760	2	-14	2,6750	2,7815	2,8820
15Y	2,7780	2	-12	2,7870	2,8335	2,8950
20Y	2,8140	2	-11	2,7960	2,8410	2,8800
30Y	2,8210	2	-10	2,7940	2,8453	2,8400



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	67,11	0,04	5,73	OT 2Y	-0,241	-0,01	-6,80
JETFUEL	655,08	2,83	51,08	OT 5Y	0,318	-0,02	-20,60
DIESEL	626,83	4,33	59,33	OT 10Y	1,485	-0,03	-22,90
COBRE	6.374,00	-25,00	399,00	BUND 10Y	-0,484	-3,80	-14,60
ZINCO	2.703,50	-17,00	104,00	SCHATZ 2Y	0,060	-0,69	1,60
OURO	1.330,83	3,18	47,14	T-NOTE 10Y	3,375	-2,30	-7,70
TRIGO	492,00	1,00	-35,00	T-NOTE 2Y	2,871	-2,73	-5,90
LICENÇA C02	18,84	0,04	-6,37	GILT 10Y	1,399	-4,57	-14,80


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1325	-0,26%	-0,26%	1,1412	1,1499	1,1680
EUR/GBP	0,87263	-0,52%	0,84%	0,8753	0,8781	0,8843
EUR/JPY	125,56	0,11%	-1,04%	125,56	125,56	125,56
EUR/CHF	1,1340	0,07%	-0,06%	1,1329	1,1318	1,1295
EUR/BRL	4,2405	0,62%	1,97%	4,3014	4,3649	4,4964
EUR/PLN	4,3353	0,03%	-1,17%	4,3562	4,3777	4,4220

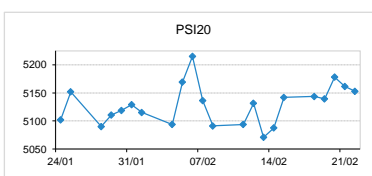

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1325	0,8726	125,56	1,1340	10,6068	7,4620	1,4960	1,58907	4,2405	9,7581
USD	0,8818	-	0,7658	110,755	0,9999	9,3580	6,5799	1,3187	1,4014	3,7361	8,6107

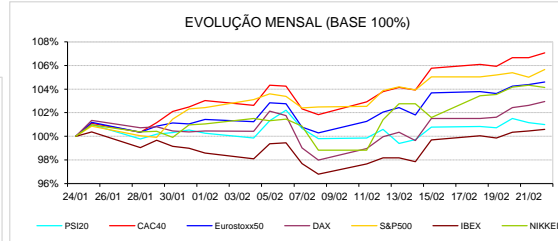
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,140	-0,83	23,10
BCP	0,231	-1,37	0,61
CORT. AMORIM	9,400	-1,26	4,44
CTT	2,794	-2,92	-5,16
EDP	3,252	0,53	6,66
EDP R	8,215	1,05	5,66
GALP	14,675	-0,41	6,38
IBERSOL	8,140	1,50	3,04
J MARTINS	12,940	0,78	25,15
MOTA ENGIL	1,948	-0,10	20,99
NAVIGATOR	4,386	-0,27	21,83
NOS	5,305	-0,28	0,19
NOVABASE	2,410	-0,82	19,31
PHAROL	0,184	1,88	12,75
REN	2,600	0,23	6,82
SEMAPA	15,440	-0,90	17,86
SONAE CAP.	0,874	-1,80	2,94
SONAE SGPS	0,909	-0,11	12,16

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	1,88
IBERSOL	1,50
EDP R	1,05
J MARTINS	0,78
EDP	0,53
SEMAPA	-0,90
CORT. AMORIM	-1,26
BCP	-1,37
SONAE CAP.	-1,80
CTT	-2,92



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.152,69	-0,17%	8,90%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.215,85	0,38%	10,26%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.270,55	0,21%	8,97%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.457,70	0,30%	8,51%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.791,61	0,61%	11,36%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.204,60	0,15%	7,78%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.425,51	-0,18%	7,05%	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.