

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

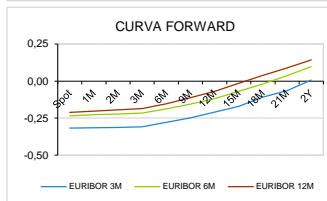
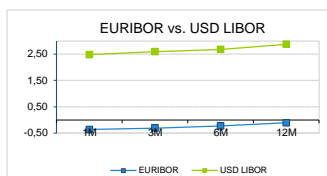
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

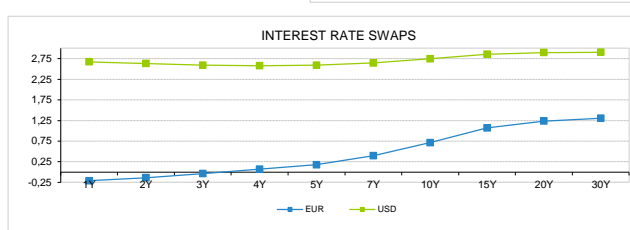
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4819	-1	-3	0,7276	-0,7844
3M	-0,3090	0	0	3M	2,5985	-2	-13	0,8528	-0,7056
6M	-0,2300	0	1	6M	2,6821	0	-11	0,9868	-0,6482
12M	-0,1080	0	0	12M	2,8790	1	-8	1,1353	-0,5052

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2112	0	1	-0,0701	0,3567	0,8110
2Y	-0,1350	1	2	0,0364	0,4650	0,9249
3Y	-0,0370	1	3	0,1420	0,5795	1,0347
4Y	0,0680	1	4	0,2500	0,6954	1,1383
5Y	0,1760	2	4	0,3620	0,8053	1,2298
7Y	0,3970	2	3	0,5820	1,0078	1,3813
10Y	0,7110	2	3	0,8750	1,2272	1,5228
15Y	1,0690	2	4	1,1719	1,4121	1,6101
20Y	1,2370	3	5	1,3052	1,4709	1,5970
30Y	1,3060	3	6	1,3430	1,4445	1,5140

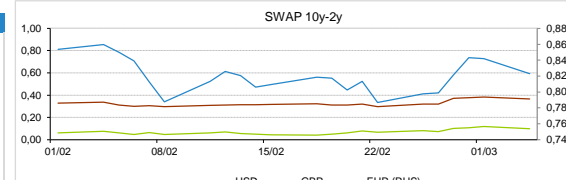
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



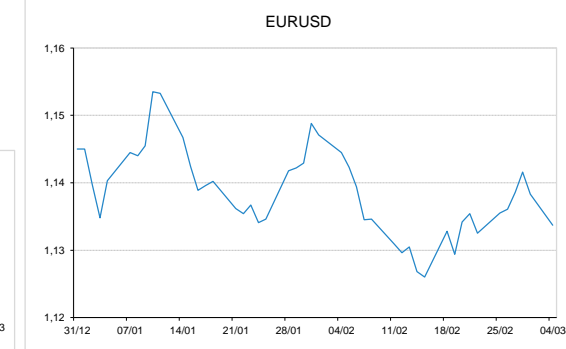
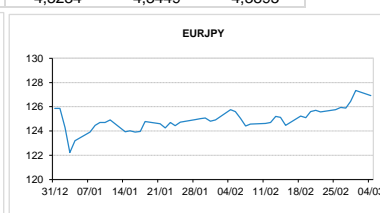
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6730	0	-4	2,6027	2,5239	2,6920
2Y	2,6300	1	-3	2,5220	2,5450	2,7748
3Y	2,5890	1	-2	2,5350	2,5955	2,7980
4Y	2,5760	1	-1	2,5340	2,6440	2,8647
5Y	2,5880	1	0	2,5877	2,6930	2,9024
7Y	2,6430	1	1	2,6626	2,7770	2,9370
10Y	2,7440	2	3	2,7495	2,8635	2,9983
15Y	2,8540	2	5	2,8460	2,9375	2,9850
20Y	2,8950	2	6	2,8969	2,9235	2,9700
30Y	2,9050	2	7	2,8760	2,9050	2,9330



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	65,81	0,74	3,23	OT 2Y	-0,248	0,00	-4,00
JETFUEL	655,00	1,25	59,50	OT 5Y	0,290	-0,03	-13,80
DIESEL	630,73	0,98	72,23	OT 10Y	1,464	-0,03	-15,60
COBRE	6.442,00	-31,00	339,00	BUND 10Y	-0,411	-2,60	0,60
ZINCO	2.814,50	9,00	17,50	SCHATZ 2Y	0,094	-0,23	3,70
OURO	1.286,92	-11,63	-27,56	T-NOTE 10Y	3,409	-1,65	10,10
TRIGO	457,50	0,25	-72,25	T-NOTE 2Y	2,889	-0,78	13,60
LICENÇA C02	22,94	0,66	-0,12	GILT 10Y	1,223	-2,33	4,80


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1337	-0,40%	-0,94%	1,1424	1,1512	1,1692
EUR/GBP	0,85775	0,23%	2,22%	0,8604	0,8632	0,8694
EUR/JPY	126,91	0,35%	-0,90%	126,91	126,91	126,91
EUR/CHF	1,1323	0,31%	0,75%	1,1312	1,1302	1,1278
EUR/BRL	4,2943	-0,53%	-2,38%	4,3571	4,4243	4,5609
EUR/PLN	4,3030	0,04%	-0,36%	4,3234	4,3449	4,3895

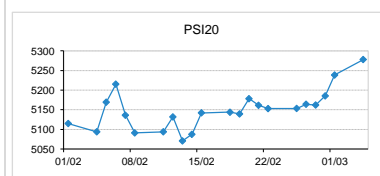

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1337	0,8578	126,91	1,1323	10,5776	7,4612	1,5087	1,59835	4,2943	9,7968
USD	0,8834	-	0,759	111,855	1,0000	9,3418	6,5905	1,3322	1,4115	3,7776	8,6533

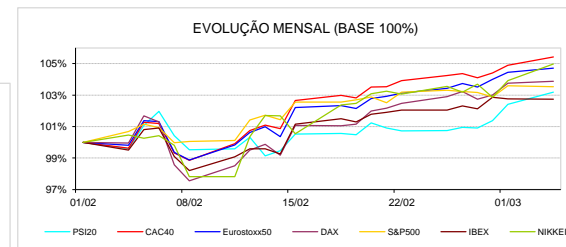
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,590	3,97	30,86
BCP	0,244	0,33	6,45
CORT. AMORIM	10,300	0,39	14,44
CTT	2,824	0,21	-4,14
EDP	3,233	-0,09	6,03
EDP R	8,355	0,42	7,46
GALP	14,715	1,41	6,67
IBERSOL	8,080	0,25	2,28
J MARTINS	13,415	-0,85	29,74
MOTA ENGIL	2,235	4,68	38,82
NAVIGATOR	4,412	2,13	22,56
NOS	5,350	0,47	1,04
NOVABASE	2,520	0,80	24,75
PHAROL	0,192	0,21	17,28
REN	2,654	0,76	9,04
SEMAPA	15,540	1,44	18,63
SONAE CAP.	0,899	4,05	5,89
SONAE SGPS	0,966	1,68	19,26

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	4,68
SONAE CAP.	4,05
ALTRI	3,97
NAVIGATOR	2,13
SONAE SGPS	1,68
EDP	-0,09
J MARTINS	-0,85



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.278,24	0,75%	11,55%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.291,48	0,50%	11,85%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.321,07	0,26%	10,64%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.613,35	0,11%	9,99%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.802,33	-0,05%	11,79%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.267,00	0,00%	8,52%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.822,04	1,02%	9,03%	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.