

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

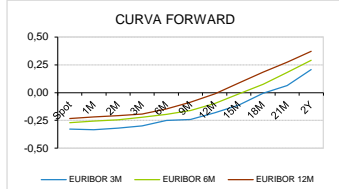
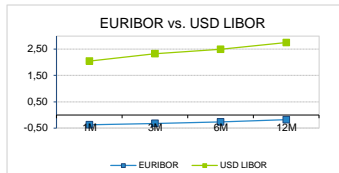
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

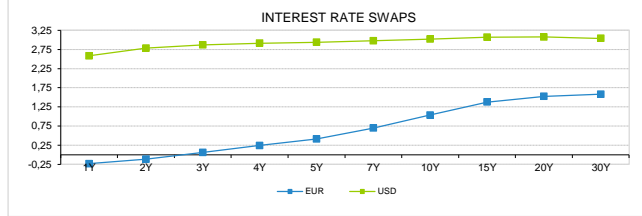
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	2,0464	2	12	0,4977	-0,7936
3M	-0,3210	0	1	3M	2,3271	1	-4	0,6328	-0,7328
6M	-0,2670	0	0	6M	2,4919	1	-3	0,7569	-0,6450
12M	-0,1800	0	1	12M	2,7538	1	-2	0,9361	-0,5238

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2329	0	3	-0,0113	0,7280	1,2950
2Y	-0,1150	2	3	0,1806	0,8780	1,4010
3Y	0,0590	3	4	0,3611	1,0160	1,4990
4Y	0,2420	5	4	0,5254	1,1370	1,5840
5Y	0,4110	6	4	0,6776	1,2470	1,6600
7Y	0,6990	7	5	0,9350	1,4300	1,7680
10Y	1,0370	7	7	1,2250	1,6124	1,8700
15Y	1,3770	7	8	1,4928	1,7550	1,9180
20Y	1,5280	6	7	1,6004	1,7816	1,8830
30Y	1,5810	6	7	1,6136	1,7310	1,7920

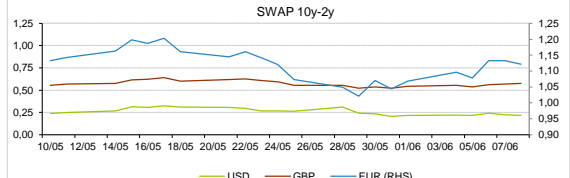
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



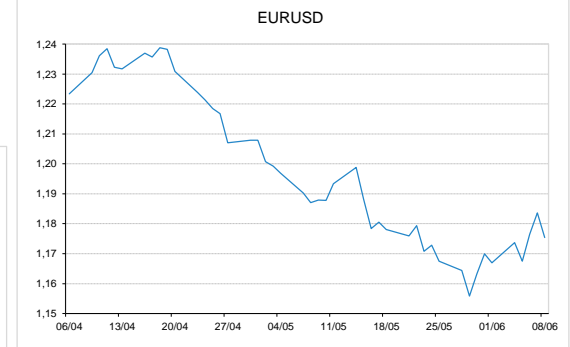
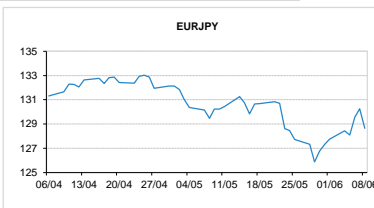
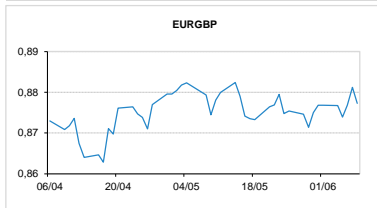
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5820	1	3	2,9674	2,9810	2,9790
2Y	2,7820	2	3	2,9886	2,9715	2,9920
3Y	2,8700	2	3	2,9520	2,9755	3,0140
4Y	2,9140	3	3	2,9923	2,9705	3,0110
5Y	2,9390	4	3	2,9565	2,9965	3,0764
7Y	2,9740	4	4	2,9735	3,0512	3,0560
10Y	3,0220	4	5	3,0235	3,0797	3,0610
15Y	3,0680	4	4	3,0380	3,0855	3,0951
20Y	3,0750	4	4	3,0240	3,0280	3,0270
30Y	3,0400	5	3	2,9790	2,9755	2,9675



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	76,50	-0,82	1,93	OT 2Y	0,025	0,04	21,70
JETFUEL	714,47	3,37	25,13	OT 5Y	0,916	0,06	33,50
DIESEL	671,22	1,87	27,88	OT 10Y	2,056	0,03	34,30
COBRE	7.247,00	112,00	506,00	BUND 10Y	-0,029	-5,56	-13,20
ZINCO	3.204,00	-7,50	149,00	SCHATZ 2Y	-0,025	-4,59	-12,80
OURO	1.298,80	1,15	-15,41	T-NOTE 10Y	3,639	-0,51	-7,80
TRIGO	516,00	-10,75	1,50	T-NOTE 2Y	2,934	-0,78	-9,00
LICENÇA C02	15,84	-0,16	2,24	GILT 10Y	1,629	-1,75	-8,20


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1754	-0,69%	-0,98%	1,1838	1,1925	1,2121
EUR/GBP	0,87733	0,44%	0,22%	0,8798	0,8825	0,8885
EUR/JPY	128,64	1,26%	0,63%	128,64	128,64	128,64
EUR/CHF	1,1611	-0,14%	2,49%	1,1600	1,1587	1,1563
EUR/BRL	4,4022	4,76%	-3,94%	4,4739	4,5548	4,7428
EUR/PLN	4,2790	-0,12%	0,02%	4,3015	4,3236	4,3697

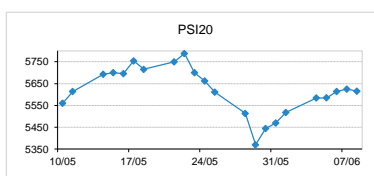

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1754	0,8773	128,64	1,1611	10,2628	7,4490	1,5252	1,54885	4,4022	9,4868
USD	0,8501	-	0,7465	109,37	0,9856	8,7306	6,3322	1,2967	1,3161	3,7922	8,0602

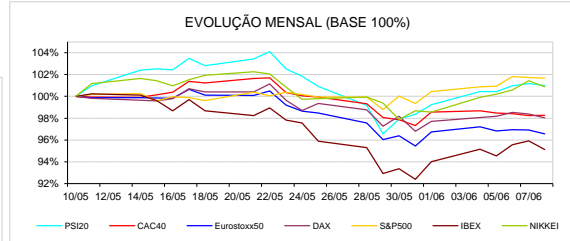
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	8,840	3,76	70,95
BCP	0,265	-1,89	-2,43
CORT. AMORIM	11,4400	1,96	11,07
CTT	2,8100	-1,20	-19,87
EDP	3,376	0,18	17,02
EDP R	8,150	-0,61	16,98
GALP	16,085	-1,95	4,96
IBERSOL	11,000	0,92	-9,47
J MARTINS	13,335	-0,86	-17,66
MOTA ENGIL	3,220	-1,23	-12,09
NAVIGATOR	5,900	3,60	38,76
NOS	4,646	-0,34	-15,23
NOVABASE	2,780	0,36	-8,82
PHAROL	0,259	-1,52	3,60
REN	2,334	-1,27	-5,85
SEMAPA	23,600	2,16	32,62
SONAE CAP.	0,940	-2,59	5,98
SONAE SGPS	1,095	0,00	-2,75

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	3,76
NAVIGATOR	3,60
SEMAPA	2,16
CORT. AMORIM	1,96
IBERSOL	0,92
REN	-1,27
PHAROL	-1,52
BCP	-1,89
GALP	-1,95
SONAE CAP.	-2,59



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.615,38	-0,16%	4,21%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.450,22	0,03%	2,59%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.447,30	-0,36%	-1,62%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.766,55	-0,35%	-1,17%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.768,28	-0,08%	3,54%	2.872,87	2.405,70
IBEX 35	9.746,30	-0,84%	-2,96%	11.048,00	9.327,60
NIKKEI 225	22.694,50	-0,56%	-0,31%	24.129,34	19.239,52



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.