

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

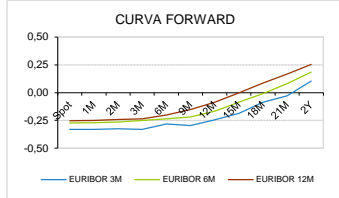
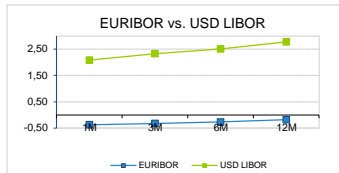
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

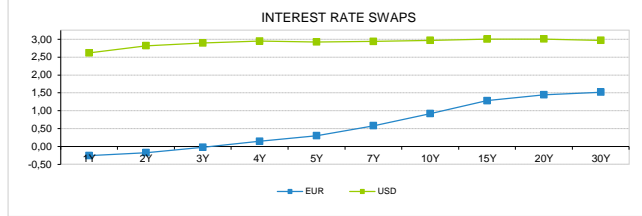
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3700	0	0	1M	2,0849	0	15	0,5064	-0,7834
3M	-0,3230	0	0	3M	2,3259	-1	1	0,6308	-0,7312
6M	-0,2680	0	0	6M	2,5038	0	1	0,7569	-0,6426
12M	-0,1840	0	1	12M	2,7722	0	2	0,9367	-0,5234

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2535	0	-1	-0,0872	0,6035	1,1623
2Y	-0,1710	-5	-5	0,0821	0,7468	1,2790
3Y	-0,0200	-7	-9	0,2545	0,8850	1,3929
4Y	0,1450	-9	-12	0,4095	1,0126	1,4914
5Y	0,3020	-10	-14	0,5599	1,1301	1,5775
7Y	0,5810	-10	-15	0,8240	1,3324	1,7099
10Y	0,9220	-9	-13	1,1328	1,5366	1,8332
15Y	1,2820	-7	-10	1,4313	1,7086	1,9092
20Y	1,4480	-5	-8	1,5651	1,7591	1,8903
30Y	1,5210	-3	-6	1,6056	1,7354	1,8201

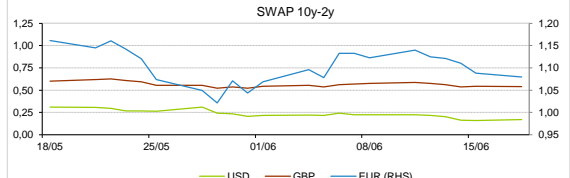
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



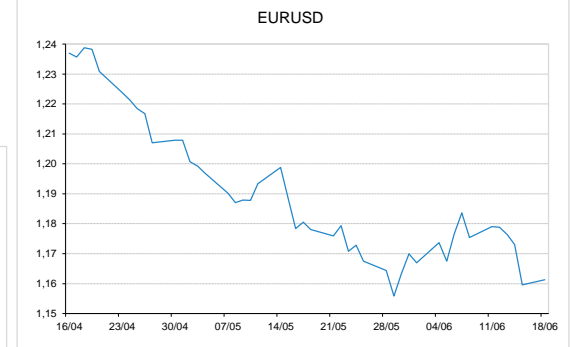
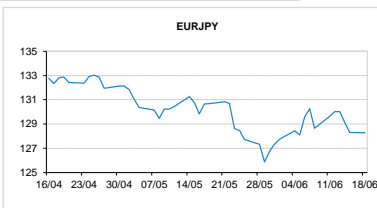
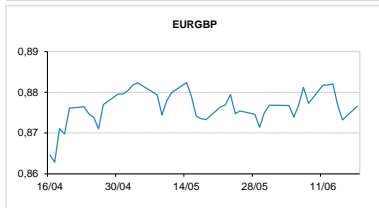
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6190	1	9	3,0392	3,0180	2,9945
2Y	2,8180	-2	4	3,0540	3,0093	3,0046
3Y	2,8950	-2	0	3,0431	2,9660	3,0179
4Y	2,9460	1	5	3,0320	2,9740	3,0040
5Y	2,9260	-3	-6	3,0000	3,0143	3,0480
7Y	2,9380	-4	-9	3,0010	3,0015	3,0723
10Y	2,9670	-4	-12	3,0492	3,0621	3,0816
15Y	3,0030	-4	-13	3,0654	3,0450	3,0440
20Y	3,0060	-4	-14	3,0576	3,0220	3,0218
30Y	2,9700	-4	-14	3,0111	2,9968	2,9842



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	74,33	0,89	-4,16	OT 2Y	-0,140	-0,01	1,30
JETFUEL	693,25	8,75	-52,75	OT 5Y	0,619	-0,06	-1,30
DIESEL	652,00	7,00	-49,00	OT 10Y	1,748	-0,07	-5,50
COBRE	7.011,50	-157,00	212,00	BUND 10Y	-0,087	0,00	-26,80
ZINCO	3.119,25	-100,25	61,50	SCHATZ 2Y	0,002	0,00	-10,80
OURO	1.278,40	1,81	-14,28	T-NOTE 10Y	3,644	0,00	-16,00
TRIGO	505,50	-8,00	-28,50	T-NOTE 2Y	2,973	-0,78	-9,00
LICENÇA C02	14,66	0,13	-0,59	GILT 10Y	1,559	0,77	-24,00


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1613	0,15%	-1,43%	1,1694	1,1781	1,1977
EUR/GBP	0,87655	-0,38%	-0,38%	0,8790	0,8816	0,8876
EUR/JPY	128,27	0,03%	1,89%	128,27	128,27	128,27
EUR/CHF	1,1550	0,21%	1,65%	1,1539	1,1527	1,1504
EUR/BRL	4,3567	-0,57%	0,98%	4,4290	4,4993	4,6704
EUR/PLN	4,2972	-0,25%	0,09%	4,3211	4,3458	4,3937

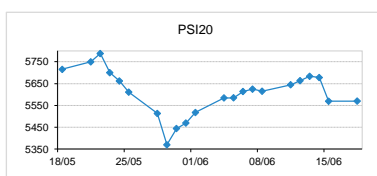

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1613	0,8766	128,27	1,1550	10,2498	7,4518	1,5359	1,56499	4,3567	9,4525
USD	0,8612	-	0,7551	110,445	0,9944	8,8268	6,4177	1,3209	1,3467	3,7574	8,1397

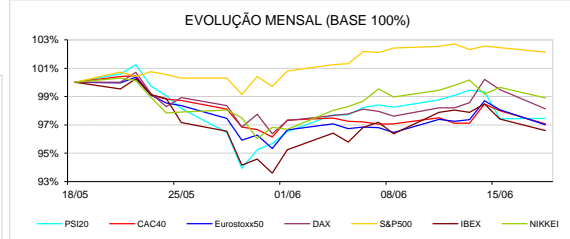
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	8,440	0,24	63,22
BCP	0,265	-0,30	-2,57
CORT. AMORIM	11,3400	2,16	10,10
CTT	2,9560	0,61	-15,71
EDP	3,390	0,59	17,50
EDP R	8,350	-0,89	19,85
GALP	16,045	1,65	4,70
IBERSOL	11,400	1,79	-6,17
J MARTINS	13,070	-1,21	-19,30
MOTA ENGIL	3,020	-2,74	-17,55
NAVIGATOR	5,345	-1,29	26,65
NOS	4,700	-0,38	-14,25
NOVABASE	2,760	0,36	-9,48
PHAROL	0,241	-0,62	-3,80
REN	2,384	0,51	-3,83
SEMAPA	23,250	1,58	30,65
SONAE CAP.	0,910	-1,73	2,59
SONAE SGPS	1,118	1,54	-0,71

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	2,16
IBERSOL	1,79
GALP	1,65
SEMAPA	1,58
SONAE SGPS	1,54
EDP R	-0,89
J MARTINS	-1,21
NAVIGATOR	-1,29
SONAE CAP.	-1,73
MOTA ENGIL	-2,74



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.569,83	0,01%	3,37%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.450,48	-0,93%	2,60%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.466,65	-1,09%	-1,06%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.834,11	-1,36%	-0,65%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.770,76	-0,31%	3,64%	2.872,87	2.405,70
IBEX 35	9.769,40	-0,83%	-2,73%	10.901,50	9.327,60
NIKKEI 225	22.680,33	-0,75%	-0,37%	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.