

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

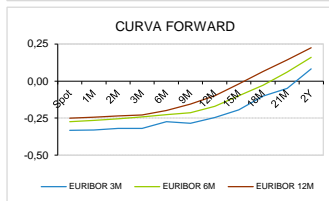
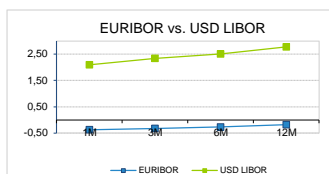
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

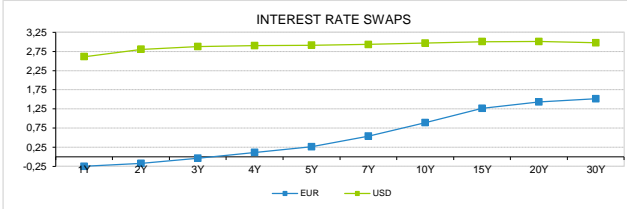
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	2,0978	1	13	0,4986	-0,7820
3M	-0,3240	0	0	3M	2,3389	0	1	0,6593	-0,7310
6M	-0,2690	0	0	6M	2,5075	0	1	0,7838	-0,6448
12M	-0,1810	0	1	12M	2,7769	1	1	0,9656	-0,5212

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2492	0	-1	-0,0988	0,5607	1,1364
2Y	-0,1710	0	-4	0,0627	0,7087	1,2609
3Y	-0,0360	0	-9	0,2268	0,8500	1,3725
4Y	0,1140	0	-13	0,3833	0,9827	1,4706
5Y	0,2630	0	-15	0,5305	1,1025	1,5457
7Y	0,5410	0	-17	0,7991	1,3058	1,6770
10Y	0,8920	0	-15	1,1095	1,5115	1,8116
15Y	1,2630	0	-12	1,4075	1,6827	1,8840
20Y	1,4340	0	-10	1,5396	1,7336	1,8649
30Y	1,5140	0	-8	1,5808	1,7129	1,7926

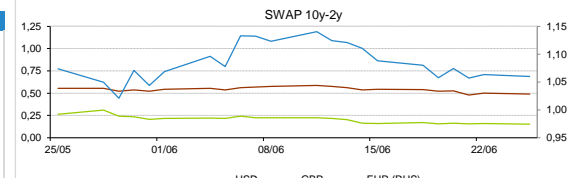
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



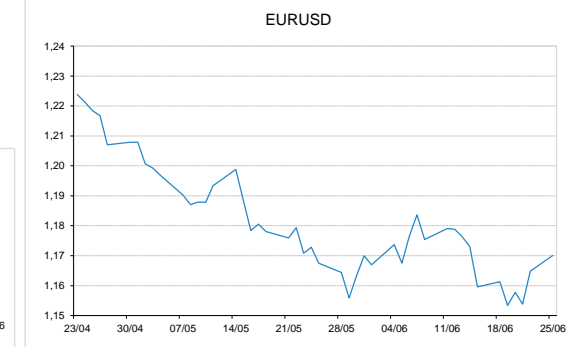
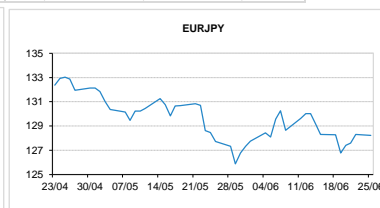
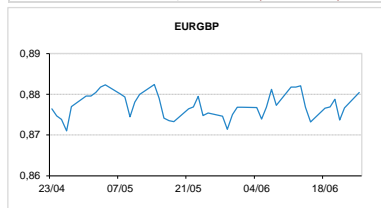
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6130	1	4	2,9807	2,9345	2,9140
2Y	2,8060	-1	0	2,9688	2,9260	2,9487
3Y	2,8750	-1	-4	2,9751	2,9075	2,9637
4Y	2,9030	-1	-7	2,9380	2,9270	2,9815
5Y	2,9140	-1	-9	2,9355	2,9350	2,9935
7Y	2,9320	0	-12	2,9420	2,9814	2,9935
10Y	2,9680	0	-14	2,9929	3,0099	3,0316
15Y	3,0060	0	-15	3,0094	2,9960	2,9920
20Y	3,0080	0	-15	3,0038	2,9969	2,9620
30Y	2,9750	0	-15	2,9285	2,9488	2,9120



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	74,42	-1,13	-2,05	OT 2Y	-0,125	0,00	-8,60
JETFUEL	687,50	-7,92	-39,50	OT 5Y	0,691	0,02	-3,60
DIESEL	647,00	-7,42	-39,25	OT 10Y	1,834	0,01	-7,00
COBRE	6.801,00	3,00	-190,00	BUND 10Y	-0,163	-0,67	-15,60
ZINCO	2.937,50	2,00	-118,50	SCHATZ 2Y	-0,048	-0,69	-8,50
OURO	1.266,61	-2,08	-37,06	T-NOTE 10Y	3,597	-2,18	-9,30
TRIGO	494,25	-10,00	-65,50	T-NOTE 2Y	2,938	-2,34	-2,70
LICENÇA C02	15,01	-0,11	-0,99	GILT 10Y	1,525	-1,35	-11,40


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,17	0,45%	0,21%	1,1781	1,1868	1,2061
EUR/GBP	0,8804	-0,43%	-0,57%	0,8829	0,8856	0,8917
EUR/JPY	128,21	0,07%	-0,38%	128,21	128,21	128,21
EUR/CHF	1,1548	-0,27%	-0,09%	1,1536	1,1524	1,1500
EUR/BRL	4,4179	-0,17%	-3,70%	4,4838	4,5505	4,6990
EUR/PLN	4,3444	-0,51%	-0,73%	4,3686	4,3933	4,4398

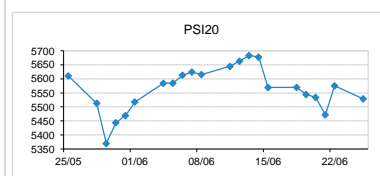

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1700	0,8804	128,21	1,1548	10,3820	7,4516	1,5574	1,58009	4,4179	9,4979
USD	0,8559	-	0,7538	109,665	0,9883	8,8810	6,3774	1,3307	1,3514	3,7803	8,1263

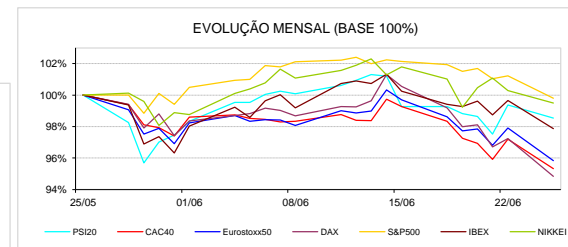
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,550	-0,70	65,35
BCP	0,265	-1,30	-2,43
CORT. AMORIM	10,9600	-2,84	6,41
CTT	3,0540	1,19	-12,92
EDP	3,400	0,15	17,85
EDP R	8,365	0,48	20,07
GALP	15,950	-0,87	4,08
IBERSOL	11,800	-1,67	-2,88
J MARTINS	13,015	-1,25	-19,64
MOTA ENGIL	2,930	-0,34	-20,01
NAVIGATOR	5,100	-1,73	20,85
NOS	4,696	-2,17	-14,32
NOVABASE	2,770	0,36	-9,15
PHAROL	0,244	-2,40	-2,40
REN	2,342	0,00	-5,53
SEMAPA	22,850	0,88	28,41
SONAE CAP.	0,906	-0,44	2,14
SONAE SGPS	1,086	-1,99	-3,55

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	1,19
SEMAPA	0,88
EDP R	0,48
NOVABASE	0,36
EDP	0,15
NAVIGATOR	-1,73
SONAE SGPS	-1,99
NOS	-2,17
PHAROL	-2,40
CORT. AMORIM	-2,84



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.528,75	-0,84%	2,61%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.283,86	-1,92%	-0,54%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.369,21	-2,10%	-3,85%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.270,33	-2,46%	-5,01%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.716,10	-1,41%	1,58%	2.872,87	2.405,70
IBEX 35	9.617,90	-1,78%	-4,24%	10.772,00	9.327,60
NIKKEI 225	22.338,15	-0,79%	-1,87%	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.