

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

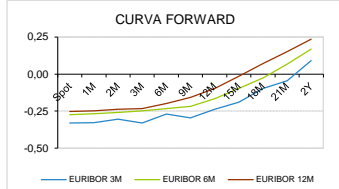
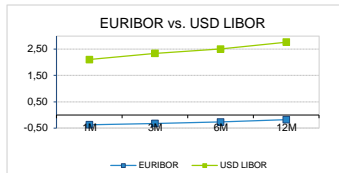
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

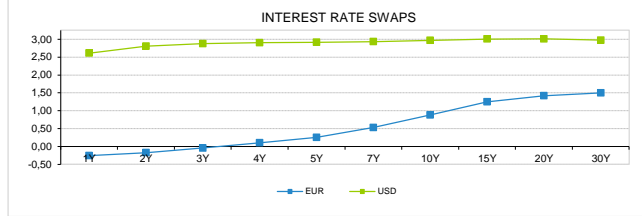
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3700	0	0	1M	2,1029	1	13	0,4980	-0,7800
3M	-0,3230	0	0	3M	2,3370	0	2	0,6640	-0,7312
6M	-0,2700	0	0	6M	2,5025	-1	2	0,7849	-0,6450
12M	-0,1810	0	1	12M	2,7659	-1	3	0,9631	-0,5212

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2529	0	-2	-0,0973	0,5933	1,1593
2Y	-0,1730	0	-2	0,0687	0,7460	1,2741
3Y	-0,0420	-1	-5	0,2427	0,8823	1,3870
4Y	0,1070	-1	-7	0,4027	1,0074	1,4828
5Y	0,2560	-1	-9	0,5508	1,1261	1,5712
7Y	0,5320	-1	-10	0,8176	1,3274	1,7046
10Y	0,8800	-1	-9	1,1291	1,5288	1,8233
15Y	1,2490	-1	-7	1,4223	1,6993	1,8982
20Y	1,4220	-1	-5	1,5529	1,7469	1,8751
30Y	1,5010	-1	-4	1,5919	1,7200	1,8026

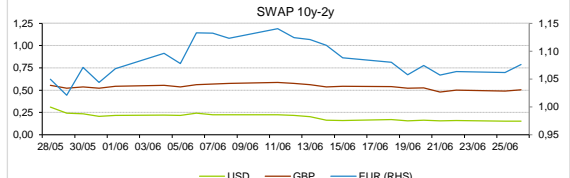
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



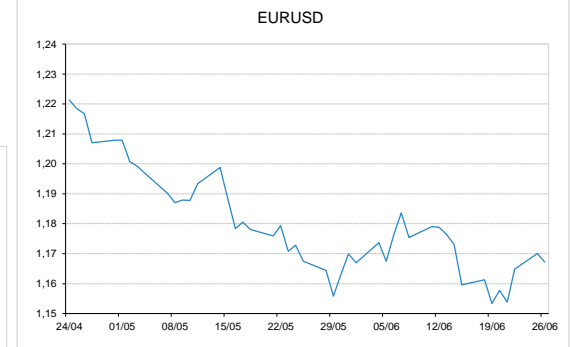
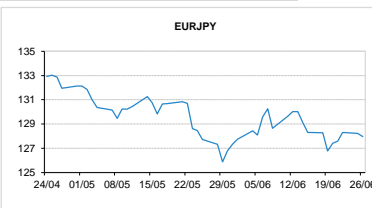
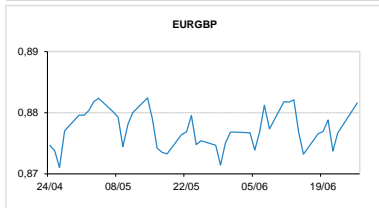
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6130	1	4	2,9823	2,9576	2,9160
2Y	2,8060	-1	0	2,9510	2,9488	2,9370
3Y	2,8750	-1	-4	2,9470	2,9145	2,9395
4Y	2,9030	-1	-7	2,9385	2,9295	2,9851
5Y	2,9140	-1	-9	2,9370	2,9390	3,0021
7Y	2,9320	0	-12	2,9440	2,9490	3,0040
10Y	2,9680	0	-14	2,9963	3,0155	3,0396
15Y	3,0060	0	-15	3,0163	3,0197	3,0298
20Y	3,0080	0	-15	3,0097	3,0059	2,9780
30Y	2,9750	0	-15	2,9676	2,9563	2,9447



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	75,90	1,17	-0,57	OT 2Y	-0,094	0,03	-18,90
JETFUEL	687,50	-7,92	-39,50	OT 5Y	0,731	0,04	-6,60
DIESEL	647,00	-7,42	-39,25	OT 10Y	1,884	0,05	-6,60
COBRE	6.704,00	-34,00	-130,00	BUND 10Y	-0,154	1,18	-8,60
ZINCO	2.880,50	-57,00	-170,50	SCHATZ 2Y	-0,041	0,46	-5,20
OURO	1.260,98	-5,04	-42,69	T-NOTE 10Y	3,597	0,00	-5,40
TRIGO	485,50	-5,00	-74,25	T-NOTE 2Y	2,938	0,00	0,80
LICENÇA C02	15,04	0,01	-0,96	GILT 10Y	1,530	0,38	-4,40


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1672	-0,24%	0,24%	1,1753	1,1840	1,2032
EUR/GBP	0,8816	-0,14%	-0,79%	0,8841	0,8868	0,8929
EUR/JPY	127,95	0,20%	-0,48%	127,95	127,95	127,95
EUR/CHF	1,1559	-0,15%	-0,04%	1,1548	1,1536	1,1512
EUR/BRL	4,4031	0,38%	-1,29%	4,4687	4,5378	4,6844
EUR/PLN	4,3331	0,30%	-0,73%	4,3571	4,3817	4,4289

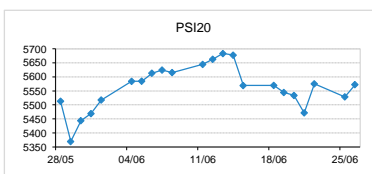

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1672	0,8816	127,95	1,1559	10,3400	7,4512	1,5518	1,57719	4,4031	9,4694
USD	0,8573	-	0,7556	109,885	0,9902	8,8551	6,3873	1,3307	1,3527	3,7745	8,1259

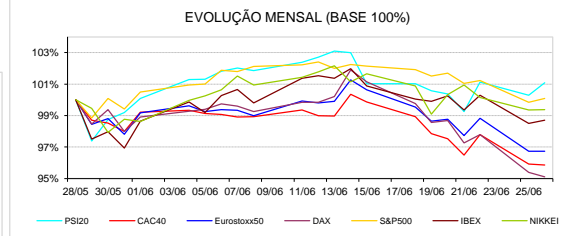
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,650	1,17	67,28
BCP	0,263	-0,79	-3,20
CORT. AMORIM	11,1000	1,28	7,77
CTT	3,0320	-0,72	-13,54
EDP	3,410	0,29	18,20
EDP R	8,890	6,28	27,60
GALP	16,030	0,50	4,60
IBERSOL	11,900	0,85	-2,06
J MARTINS	13,005	-0,08	-19,70
MOTA ENGIL	2,900	-1,02	-20,83
NAVIGATOR	5,170	1,37	22,51
NOS	4,736	0,85	-13,59
NOVABASE	2,750	-0,72	-9,81
PHAROL	0,242	-0,82	-3,20
REN	2,356	0,60	-4,96
SEMAPA	22,700	-0,66	27,56
SONAE CAP.	0,895	-1,21	0,90
SONAE SGPS	1,080	-0,55	-4,09

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
EDP R	6,28
NAVIGATOR	1,37
CORT. AMORIM	1,28
ALTRI	1,17
NOS	0,85
NOVABASE	-0,72
BCP	-0,79
PHAROL	-0,82
MOTA ENGIL	-1,02
SONAE CAP.	-1,21



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.572,36	0,79%	3,42%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.281,29	-0,05%	-0,59%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.368,72	-0,01%	-3,86%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.234,34	-0,29%	-5,29%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.723,43	0,24%	1,87%	2.872,87	2.405,70
IBEX 35	9.637,40	0,20%	-4,05%	10.772,00	9.327,60
NIKKEI 225	22.342,00	0,02%	-1,86%	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.