

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

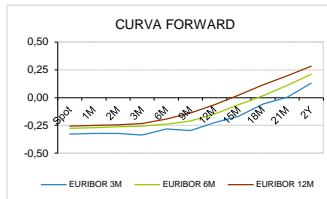
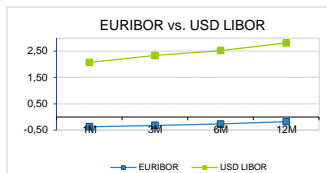
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

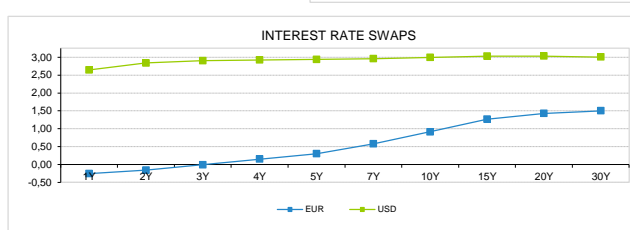
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,0701	1	-3	0,6249	-0,7762
3M	-0,3210	0	0	3M	2,3349	0	0	0,7823	-0,7236
6M	-0,2690	0	0	6M	2,5225	0	2	0,8880	-0,6484
12M	-0,1790	0	0	12M	2,8080	1	3	1,0308	-0,5148

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2564	0	-1	-0,0638	0,6183	1,1447
2Y	-0,1560	0	2	0,1101	0,7622	1,2576
3Y	-0,0080	1	3	0,2795	0,8888	1,3607
4Y	0,1520	1	4	0,4360	1,0073	1,4543
5Y	0,3030	1	4	0,5745	1,1170	1,5280
7Y	0,5770	1	4	0,8240	1,3068	1,6593
10Y	0,9140	1	2	1,1189	1,4981	1,7762
15Y	1,2670	1	0	1,3972	1,6569	1,8419
20Y	1,4310	1	0	1,5177	1,6995	1,8197
30Y	1,5020	0	-1	1,5490	1,6746	1,7460

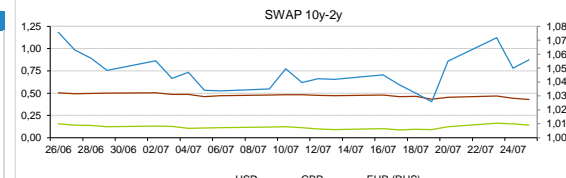
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



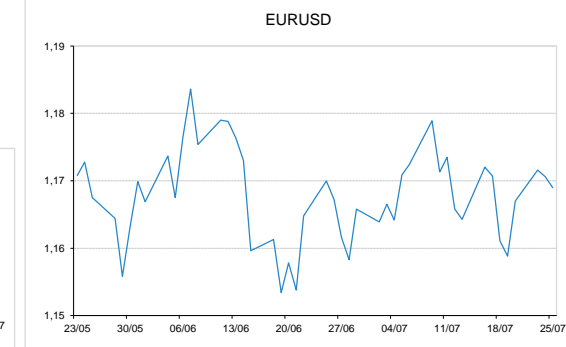
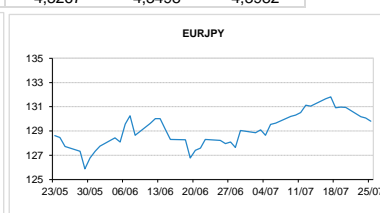
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6430	0	3	3,0455	2,9805	2,9859
2Y	2,8390	1	3	3,0210	3,0034	2,9650
3Y	2,9010	2	3	3,0363	2,9985	2,9740
4Y	2,9260	3	2	2,9985	2,9780	3,0227
5Y	2,9400	4	3	3,0192	3,0053	3,0382
7Y	2,9600	4	3	3,0174	3,0050	3,0300
10Y	2,9950	4	3	3,0408	3,0185	3,0365
15Y	3,0290	4	2	3,0526	3,0330	3,0320
20Y	3,0340	4	3	3,0150	3,0120	3,0015
30Y	3,0060	4	3	2,9780	2,9680	2,9480



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	73,93	0,49	-0,62	OT 2Y	-0,135	-0,04	-1,00
JETFUEL	702,33	2,16	14,83	OT 5Y	0,557	-0,03	-13,40
DIESEL	660,58	1,41	13,58	OT 10Y	1,733	-0,05	-10,10
COBRE	6.262,00	165,00	-494,00	BUND 10Y	-0,174	-0,37	-0,80
ZINCO	2.624,50	59,50	-297,00	SCHATZ 2Y	0,016	0,69	6,20
OURO	1.228,82	3,54	-37,20	T-NOTE 10Y	3,639	-0,84	4,20
TRIGO	538,00	27,75	47,50	T-NOTE 2Y	3,031	0,78	9,70
LICENÇA C02	17,27	0,17	2,24	GILT 10Y	1,485	0,19	-4,10


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,169	-0,14%	-0,09%	1,1772	1,1862	1,2053
EUR/GBP	0,88855	0,36%	-0,92%	0,8912	0,8941	0,9006
EUR/JPY	129,8	0,20%	-1,23%	129,80	129,80	129,80
EUR/CHF	1,1612	0,01%	-0,61%	1,1601	1,1588	1,1566
EUR/BRL	4,3293	1,20%	2,09%	4,4003	4,4711	4,6283
EUR/PLN	4,3035	0,00%	0,99%	4,3267	4,3498	4,3982

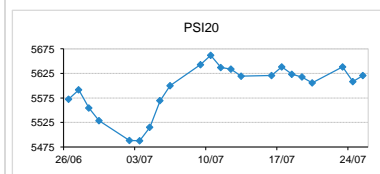

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1690	0,8886	129,80	1,1612	10,2822	7,4513	1,5304	1,5755	4,3293	9,5391
USD	0,8565	-	0,7605	110,975	0,9939	8,8149	6,3822	1,3122	1,3503	3,7066	8,1834

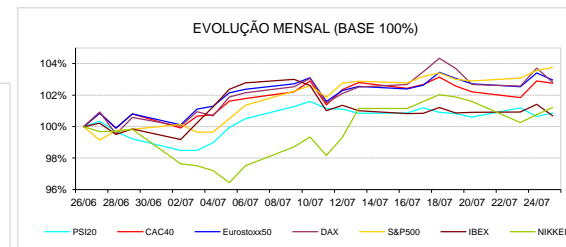
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,790	-0,34	69,99
BCP	0,267	0,07	-1,69
CORT. AMORIM	11,1400	-0,18	8,16
CTT	3,0480	2,01	-13,09
EDP	3,445	0,50	19,41
EDP R	8,800	-0,85	26,31
GALP	17,140	0,53	11,84
IBERSOL	10,150	-1,93	0,25
J MARTINS	13,290	0,53	-17,94
MOTA ENGIL	2,890	0,52	-21,10
NAVIGATOR	5,015	1,23	18,84
NOS	4,870	-1,50	-11,15
NOVABASE	2,730	0,00	-10,46
PHAROL	0,237	-0,21	-5,20
REN	2,476	0,24	-0,12
SEMAPA	20,750	1,22	16,61
SONAE CAP.	0,930	0,11	4,85
SONAE SGPS	0,979	1,19	-13,06

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
CTT	2,01
NAVIGATOR	1,23
SEMAPA	1,22
SONAE SGPS	1,19
J MARTINS	0,53
PHAROL	-0,21
ALTRI	-0,34
EDP R	-0,85
NOS	-1,50
IBERSOL	-1,93



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.620,52	0,22%	4,31%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.426,41	-0,14%	2,14%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.468,45	-0,43%	-1,01%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.579,33	-0,87%	-2,62%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.825,10	0,17%	5,67%	2.872,87	2.417,35
IBEX 35	9.703,10	-0,72%	-3,39%	10.758,20	9.327,60
NIKKEI 225	22.614,25	0,46%	-0,66%	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.