

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

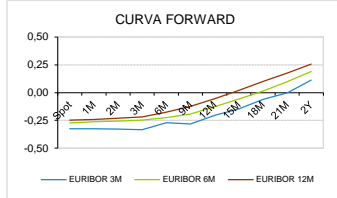
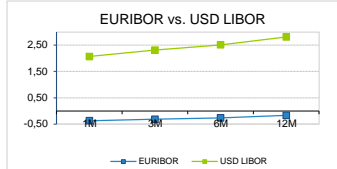
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

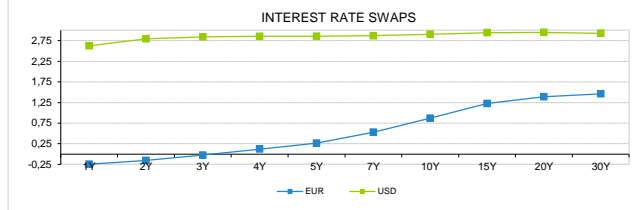
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	2,0659	0	0	0,7216	-0,7766
3M	-0,3190	0	0	3M	2,3103	0	-3	0,8044	-0,7256
6M	-0,2660	0	0	6M	2,5129	0	-1	0,8944	-0,6500
12M	-0,1670	0	1	12M	2,8078	-1	1	1,0408	-0,5166

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2474	0	1	-0,0563	0,5680	1,1014
2Y	-0,1560	0	1	0,1012	0,7080	1,2197
3Y	-0,0240	0	0	0,2550	0,8410	1,3294
4Y	0,1210	0	0	0,4030	0,9620	1,4210
5Y	0,2630	0	0	0,5430	1,0750	1,5000
7Y	0,5300	0	0	0,7920	1,2738	1,6310
10Y	0,8670	0	1	1,0916	1,4717	1,7500
15Y	1,2240	0	1	1,3764	1,6350	1,8180
20Y	1,3880	0	0	1,4999	1,6811	1,7950
30Y	1,4600	0	0	1,5315	1,6490	1,7260

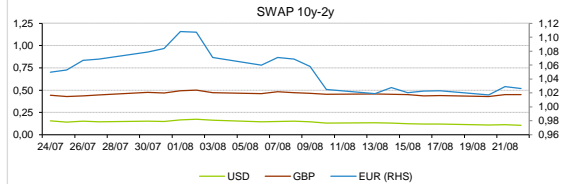
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



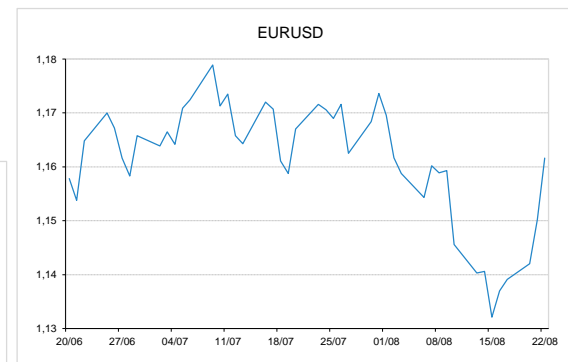
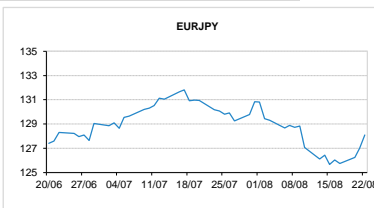
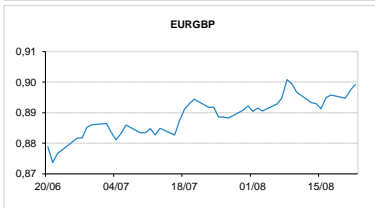
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6220	-1	-2	2,9614	2,8799	2,8791
2Y	2,7960	-1	-3	2,9418	2,8718	2,8740
3Y	2,8410	-2	-4	2,9000	2,8724	2,9119
4Y	2,8520	-2	-5	2,9078	2,8620	2,9040
5Y	2,8560	-2	-5	2,8820	2,8969	2,9521
7Y	2,8680	-2	-5	2,8870	2,9040	2,9570
10Y	2,9030	-2	-5	2,9425	2,9380	2,9710
15Y	2,9430	-2	-4	2,9460	2,9520	2,9660
20Y	2,9500	-2	-4	2,9455	2,9660	2,9450
30Y	2,9260	-2	-4	2,9372	2,9020	2,8980



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	74,37	1,74	1,23	OT 2Y	-0,178	0,00	-8,50
JETFUEL	689,00	3,75	-0,50	OT 5Y	0,588	0,01	1,00
DIESEL	655,75	5,75	8,17	OT 10Y	1,795	0,02	2,10
COBRE	6.060,50	53,50	-102,50	BUND 10Y	-0,226	1,47	-6,90
ZINCO	2.436,00	48,50	-147,50	SCHATZ 2Y	0,002	1,38	-1,40
OURO	1.196,16	3,87	-33,38	T-NOTE 10Y	3,539	-1,34	-11,70
TRIGO	548,75	1,00	15,75	T-NOTE 2Y	2,965	-0,78	-5,90
LICENÇA C02	19,74	0,43	2,67	GILT 10Y	1,481	0,48	-0,40


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1616	0,99%	-0,85%	1,1699	1,1791	1,1980
EUR/GBP	0,89928	-0,21%	-0,84%	0,9021	0,9051	0,9114
EUR/JPY	128,08	-0,84%	1,64%	128,08	128,08	128,08
EUR/CHF	1,1405	-0,05%	1,84%	1,1393	1,1381	1,1357
EUR/BRL	4,7236	-0,80%	-6,34%	4,7949	4,8692	5,0494
EUR/PLN	4,2821	0,10%	1,08%	4,3054	4,3286	4,3763

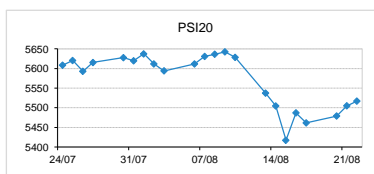

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1616	0,8993	128,08	1,1405	10,5160	7,4582	1,5092	1,57708	4,7236	9,6828
USD	0,8623	-	0,7746	110,46	0,9829	9,0709	6,4308	1,3027	1,3603	4,0797	8,3535

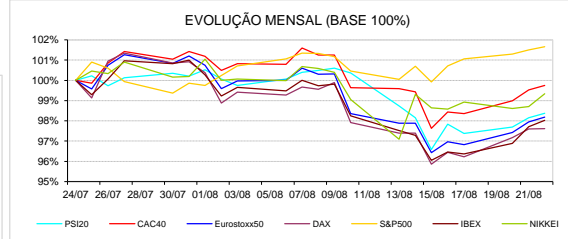
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	8,370	1,70	61,86
BCP	0,257	1,90	-5,59
CORT. AMORIM	10,8200	0,37	5,05
CTT	3,3600	-0,18	-4,19
EDP	3,393	0,21	17,61
EDP R	8,725	0,29	25,23
GALP	17,695	1,37	15,46
IBERSOL	9,880	-1,00	-2,42
J MARTINS	13,090	-0,98	-19,17
MOTA ENGIL	2,875	0,00	-21,51
NAVIGATOR	4,436	0,00	5,12
NOS	4,992	0,60	-8,92
NOVABASE	2,680	-0,37	-12,10
PHAROL	0,212	-0,47	-15,20
REN	2,452	-0,57	-1,09
SEMAPA	18,140	-2,05	1,94
SONAE CAP.	0,891	2,06	0,45
SONAE SGPS	0,962	-2,63	-14,56

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE CAP.	2,06
BCP	1,90
ALTRI	1,70
GALP	1,37
NOS	0,60
REN	-0,57
J MARTINS	-0,98
IBERSOL	-1,00
SEMAPA	-2,05
SONAE SGPS	-2,63



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.516,98	0,22%	2,39%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.420,61	0,22%	2,03%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.420,18	0,25%	-2,39%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.385,70	0,01%	-4,12%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.867,23	0,15%	7,24%	2.873,23	2.428,20
IBEX 35	9.580,20	0,33%	-4,62%	10.643,40	9.327,60
NIKKEI 225	22.362,55	0,64%	-1,77%	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.