

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

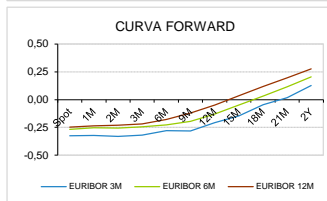
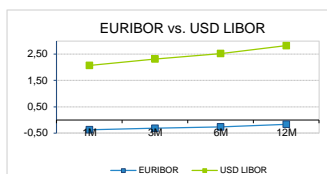
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

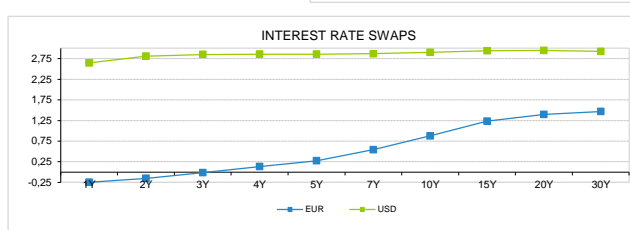
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3700	0	0	1M	2,0728	1	0	0,7229	-0,7766
3M	-0,3190	0	0	3M	2,3173	1	-2	0,8056	-0,7256
6M	-0,2650	0	0	6M	2,5230	1	0	0,8986	-0,6500
12M	-0,1660	0	1	12M	2,8200	1	1	1,0428	-0,5186

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2476	0	1	-0,0527	0,6025	1,1361
2Y	-0,1530	0	0	0,1117	0,7473	1,2450
3Y	-0,0150	0	-1	0,2747	0,8758	1,3587
4Y	0,1330	0	-2	0,4278	0,9921	1,4523
5Y	0,2750	0	-3	0,5670	1,1055	1,5298
7Y	0,5410	0	-4	0,8169	1,3025	1,6598
10Y	0,8760	0	-4	1,1150	1,4996	1,7870
15Y	1,2320	0	-4	1,4023	1,6647	1,8541
20Y	1,3970	0	-3	1,5249	1,7088	1,8321
30Y	1,4680	1	-3	1,5575	1,6769	1,7523

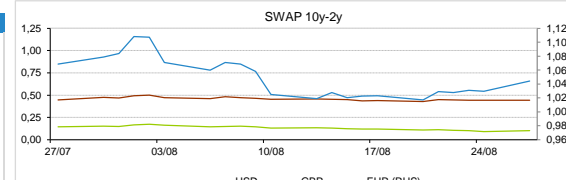
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



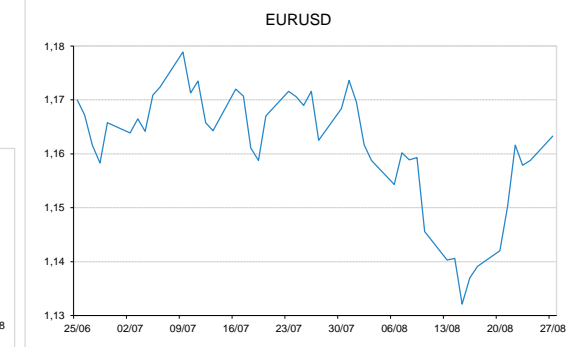
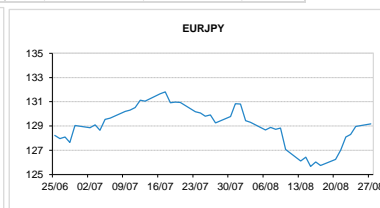
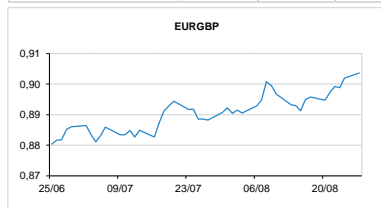
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6430	1	-1	2,9984	2,9015	2,8730
2Y	2,8100	2	-5	2,9771	2,8720	2,9223
3Y	2,8500	1	-7	2,9534	2,8710	2,8980
4Y	2,8570	1	-9	2,8990	2,8810	2,9583
5Y	2,8590	1	-10	2,8910	2,9222	2,9772
7Y	2,8680	1	-11	2,9398	2,9280	2,9685
10Y	2,9000	0	-11	2,9690	2,9455	2,9835
15Y	2,9400	0	-10	2,9700	2,9964	2,9680
20Y	2,9480	0	-10	2,9530	2,9445	2,9650
30Y	2,9240	0	-9	2,9575	2,9455	2,9060



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	75,78	-0,04	1,02	OT 2Y	-0,205	-0,01	-2,90
JETFUEL	718,00	12,75	17,83	OT 5Y	0,614	0,01	8,30
DIESEL	683,50	12,92	24,33	OT 10Y	1,837	0,01	10,60
COBRE	6.069,00	118,50	-190,00	BUND 10Y	-0,194	3,53	-3,10
ZINCO	2.548,00	66,00	-75,50	SCHATZ 2Y	0,021	1,15	0,50
OURO	1.209,20	3,64	-16,92	T-NOTE 10Y	3,562	1,67	-10,90
TRIGO	529,75	-6,75	-20,25	T-NOTE 2Y	3,000	1,17	-5,90
LICENÇA C02	21,29	0,60	4,17	GILT 10Y	1,481	0,00	-1,60


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1633	0,39%	0,07%	1,1715	1,1808	1,2000
EUR/GBP	0,90365	-0,18%	-1,71%	0,9064	0,9094	0,9158
EUR/JPY	129,16	-0,15%	0,07%	129,16	129,16	129,16
EUR/CHF	1,1442	-0,15%	1,30%	1,1431	1,1418	1,1394
EUR/BRL	4,7486	0,43%	-8,93%	4,8206	4,8952	5,0740
EUR/PLN	4,2675	0,22%	0,42%	4,2892	4,3114	4,3597

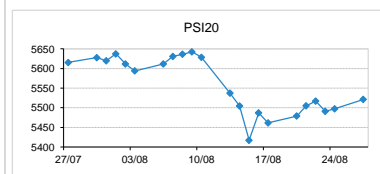

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1633	0,9037	129,16	1,1442	10,6238	7,4585	1,5148	1,58949	4,7486	9,7165
USD	0,8569	-	0,7759	111,035	0,9804	9,1023	6,3917	1,2977	1,3616	4,0573	8,3260

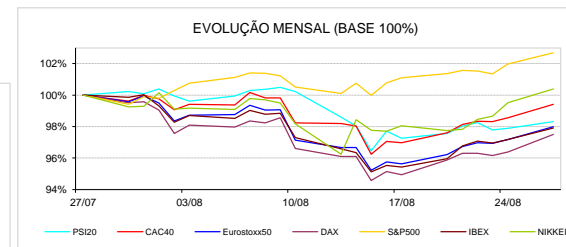
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,300	-0,12	60,51
BCP	0,255	0,16	-6,21
CORT. AMORIM	10,9200	1,11	6,02
CTT	3,3200	0,61	-5,33
EDP	3,367	-0,09	16,71
EDP R	8,610	-0,92	23,58
GALP	17,870	1,30	16,61
IBERSOL	9,680	-1,22	-4,40
J MARTINS	13,625	1,68	-15,87
MOTA ENGIL	2,850	1,97	-22,19
NAVIGATOR	4,424	-0,18	4,83
NOS	4,960	0,04	-9,51
NOVABASE	2,720	0,74	-10,79
PHAROL	0,214	-2,06	-14,40
REN	2,470	0,98	-0,36
SEMAPA	18,320	2,23	2,95
SONAE CAP.	0,893	0,90	0,68
SONAE SGPS	0,940	0,05	-16,56

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SEMAPA	2,23
MOTA ENGIL	1,97
J MARTINS	1,68
GALP	1,30
CORT. AMORIM	1,11
ALTRI	-0,12
NAVIGATOR	-0,18
EDP R	-0,92
IBERSOL	-1,22
PHAROL	-2,06



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.521,20	0,44%	2,47%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.479,10	0,86%	3,13%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.456,36	0,84%	-1,36%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.538,31	1,16%	-2,94%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.894,70	0,69%	8,27%	2.896,43	2.428,20
IBEX 35	9.661,50	0,75%	-3,81%	10.643,40	9.327,60
NIKKEI 225	22.799,64	0,88%	0,15%	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.