

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

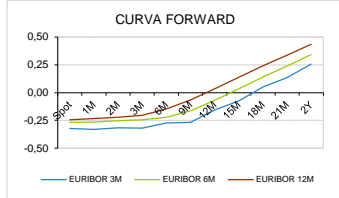
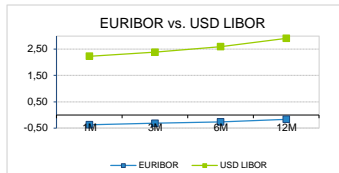
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

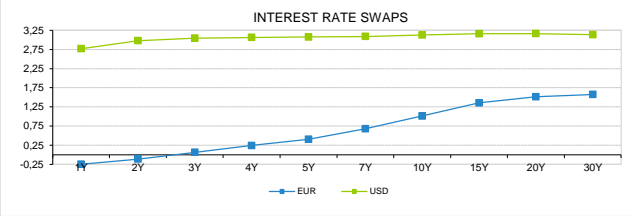
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,2301	1	16	0,7244	-0,7794
3M	-0,3190	0	0	3M	2,3810	1	6	0,8023	-0,7336
6M	-0,2670	0	0	6M	2,5954	0	7	0,8999	-0,6538
12M	-0,1640	0	0	12M	2,9119	0	9	1,0612	-0,5206

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2442	0	0	0,0346	0,7945	1,3050
2Y	-0,1110	2	4	0,2362	0,9350	1,4090
3Y	0,0650	3	8	0,4216	1,0580	1,5020
4Y	0,2420	4	11	0,5830	1,1700	1,5880
5Y	0,4030	5	13	0,7260	1,2760	1,6628
7Y	0,6810	5	14	0,9722	1,4529	1,7871
10Y	1,0110	4	14	1,2552	1,6332	1,8965
15Y	1,3560	2	12	1,5222	1,7810	1,9553
20Y	1,5140	2	12	1,6378	1,8180	1,9267
30Y	1,5740	1	11	1,6567	1,7740	1,8421

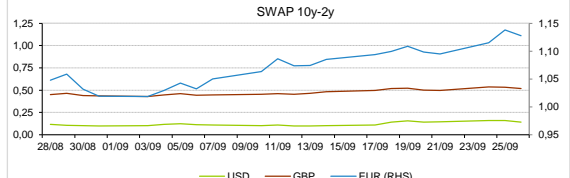
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



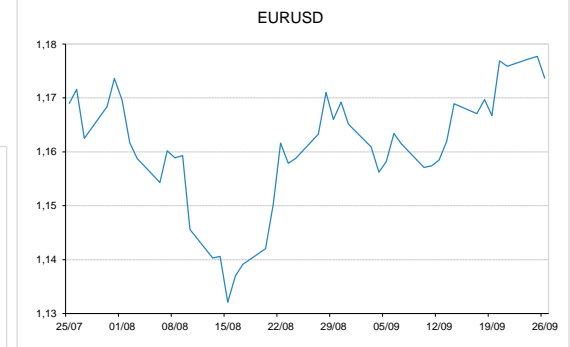
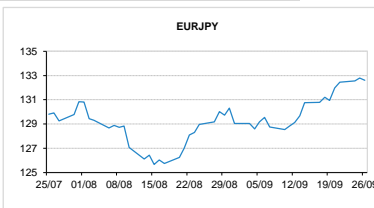
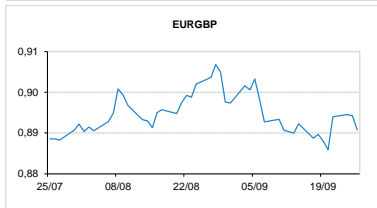
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7690	-1	13	3,2177	3,1522	3,1414
2Y	2,9790	-1	17	3,2141	3,1402	3,1555
3Y	3,0440	-1	19	3,1720	3,1175	3,1695
4Y	3,0650	0	21	3,1560	3,1466	3,1848
5Y	3,0740	0	22	3,1490	3,1573	3,1999
7Y	3,0900	0	22	3,1749	3,1815	3,2216
10Y	3,1250	0	23	3,1990	3,2078	3,2337
15Y	3,1590	-1	22	3,2162	3,2165	3,2266
20Y	3,1630	-1	22	3,2103	3,2022	3,1978
30Y	3,1330	-1	21	3,1708	3,1561	3,1492



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	81,49	-0,38	5,36	OT 2Y	-0,091	0,00	10,90
JETFUEL	753,28	0,53	35,28	OT 5Y	0,736	0,00	12,50
DIESEL	714,59	0,34	31,09	OT 10Y	1,896	0,00	6,00
COBRE	6.280,50	-35,00	213,00	BUND 10Y	0,152	-0,99	16,00
ZINCO	2.514,00	-51,50	-28,50	SCHATZ 2Y	0,129	0,00	8,80
OURO	1.194,26	-6,81	-11,30	T-NOTE 10Y	3,758	-1,02	18,30
TRIGO	524,00	3,25	-12,50	T-NOTE 2Y	3,220	-0,79	15,70
LICENÇA C02	20,17	-1,08	-0,52	GILT 10Y	1,730	-2,95	16,20


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1737	-0,34%	0,89%	1,1825	1,1921	1,2127
EUR/GBP	0,8908	0,39%	1,44%	0,8937	0,8967	0,9033
EUR/JPY	132,61	0,13%	-2,60%	132,61	132,61	132,61
EUR/CHF	1,1380	-0,28%	0,56%	1,1369	1,1356	1,1334
EUR/BRL	4,7512	0,92%	0,34%	4,8235	4,9075	5,1003
EUR/PLN	4,2775	0,34%	-0,23%	4,3003	4,3229	4,3721

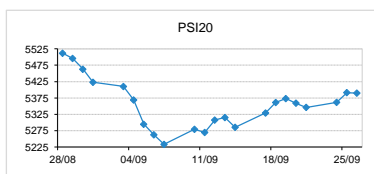

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1737	0,8908	132,61	1,1380	10,3565	7,4590	1,5235	1,61928	4,7512	9,5275
USD	0,8512	-	0,7584	113,02	0,9682	8,8127	6,3490	1,2969	1,3775	4,0597	8,1120

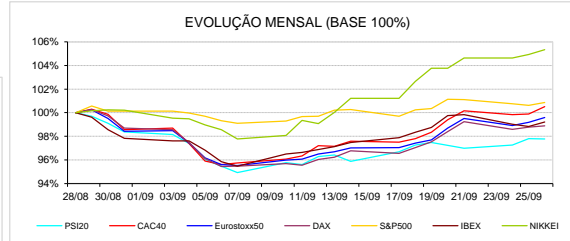
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,360	-0,24	61,67
BCP	0,263	0,65	-3,49
CORT. AMORIM	11,460	-0,69	11,26
CTT	3,370	-0,06	-3,91
EDP	3,255	-0,15	12,82
EDP R	8,780	0,52	26,02
GALP	16,950	-1,28	10,60
IBERSOL	9,500	1,28	-6,17
J MARTINS	12,705	0,59	-21,55
MOTA ENGIL	2,145	1,42	-41,44
NAVIGATOR	4,174	-0,24	-21,55
NOS	5,140	-0,48	-6,22
NOVABASE	2,660	-0,75	-12,76
PHAROL	0,180	-0,66	-28,16
REN	2,420	-0,08	-2,38
SEMAPA	17,100	-0,81	-3,91
SONAE CAP.	0,746	-1,32	-15,90
SONAE SGPS	0,905	1,69	-19,63

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
SONAE SGPS	1,69
MOTA ENGIL	1,42
IBERSOL	1,28
BCP	0,65
J MARTINS	0,59
CORT. AMORIM	-0,69
NOVABASE	-0,75
SEMAPA	-0,81
GALP	-1,28
SONAE CAP.	-1,32



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.389,87	-0,02%	0,03%	5.801,45	5.208,33
CAC40	5.512,56	0,61%	3,76%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.433,66	0,41%	-2,01%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.387,37	0,10%	-4,11%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.922,93	0,26%	9,33%	2.940,91	2.495,12
IBEX 35	9.530,20	0,39%	-5,11%	10.643,40	9.111,10
NIKKEI 225	24.033,79	0,39%	5,57%	24.129,34	20.213,66



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.