

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

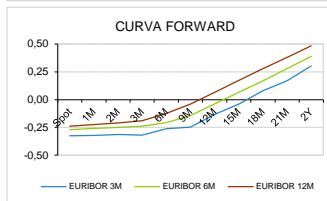
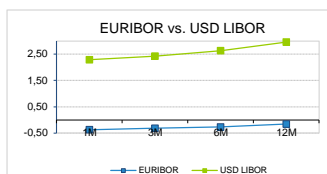
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

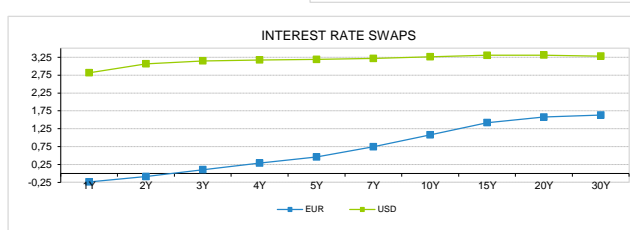
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,2871	0	16	0,7194	-0,7842
3M	-0,3180	0	0	3M	2,4204	1	9	0,8051	-0,7424
6M	-0,2680	0	0	6M	2,6290	0	9	0,9129	-0,6612
12M	-0,1560	0	1	12M	2,9620	0	12	1,0854	-0,5308

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2380	0	1	0,0642	0,8418	1,3650
2Y	-0,0860	1	6	0,2759	0,9820	1,4695
3Y	0,1030	1	11	0,4620	1,1090	1,5630
4Y	0,2900	2	14	0,6260	1,2230	1,6475
5Y	0,4600	2	17	0,7720	1,3260	1,7220
7Y	0,7450	3	18	1,0190	1,5030	1,8422
10Y	1,0780	3	18	1,3040	1,6850	1,9385
15Y	1,4210	3	17	1,5685	1,8264	1,9915
20Y	1,5750	3	16	1,6780	1,8579	1,9575
30Y	1,6300	3	14	1,6895	1,8060	1,8665

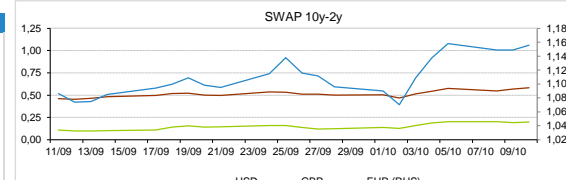
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



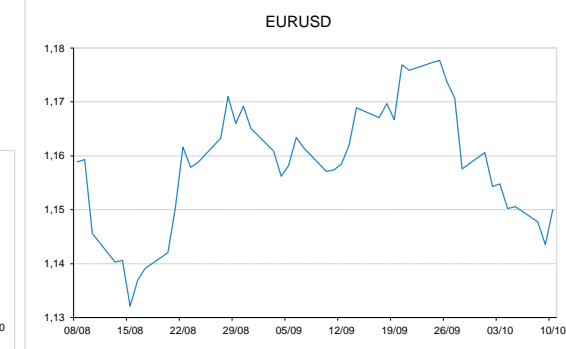
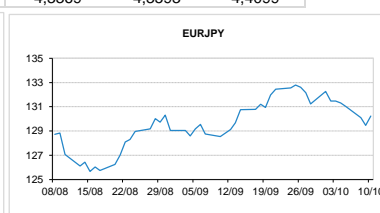
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8160	0	14	3,3273	3,2554	3,2570
2Y	3,0660	2	23	3,2810	3,2488	3,2820
3Y	3,1470	2	26	3,2675	3,2250	3,3020
4Y	3,1730	2	28	3,2520	3,2751	3,3200
5Y	3,1870	2	28	3,2490	3,2710	3,3629
7Y	3,2160	2	29	3,2765	3,3060	3,3570
10Y	3,2620	2	30	3,3130	3,3230	3,3660
15Y	3,3030	2	29	3,3260	3,3410	3,3540
20Y	3,3090	2	28	3,3270	3,3240	3,3250
30Y	3,2790	1	27	3,3089	3,2780	3,2655



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	83,40	-1,60	6,48	OT 2Y	-0,100	0,00	2,30
JETFUEL	785,71	-4,95	58,42	OT 5Y	0,798	0,00	12,40
DIESEL	743,21	-5,70	54,17	OT 10Y	1,962	-0,01	7,90
COBRE	6.295,00	114,00	359,00	BUND 10Y	0,162	1,76	13,90
ZINCO	2.720,00	63,00	297,00	SCHATZ 2Y	0,103	0,69	2,30
OURO	1.189,35	1,17	-7,03	T-NOTE 10Y	3,843	0,52	20,50
TRIGO	511,25	-3,75	-17,00	T-NOTE 2Y	3,271	0,00	14,20
LICENÇA C02	19,47	-1,32	-5,76	GILT 10Y	1,845	3,46	23,40


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,15	0,57%	-0,61%	1,1595	1,1685	1,1891
EUR/GBP	0,87448	0,27%	2,16%	0,8775	0,8805	0,8873
EUR/JPY	130,23	-0,60%	-1,30%	130,23	130,23	130,23
EUR/CHF	1,1431	-0,33%	-1,07%	1,1419	1,1406	1,1384
EUR/BRL	4,3384	-1,60%	9,18%	4,4101	4,4828	4,6569
EUR/PLN	4,3131	-0,13%	0,04%	4,3369	4,3593	4,4099

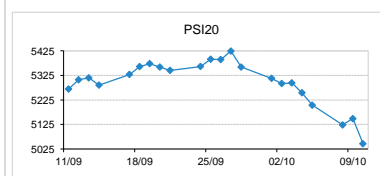

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1500	0,8745	130,23	1,1431	10,5009	7,4595	1,4978	1,62554	4,3384	9,4683
USD	0,8672	-	0,7576	112,725	0,9900	9,1023	6,4687	1,2981	1,4084	3,7477	8,1995

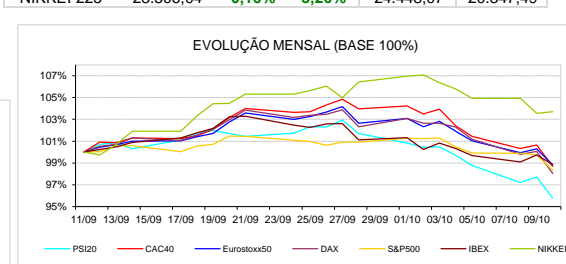
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,820	-10,83	51,23
BCP	0,227	0,04	-16,69
CORT. AMORIM	10,460	-3,15	1,55
CTT	3,190	-4,95	-9,04
EDP	3,140	-0,32	8,84
EDP R	8,300	-2,41	19,13
GALP	16,505	-0,03	7,70
IBERSOL	9,040	-0,66	-10,72
J MARTINS	11,200	-2,23	-30,84
MOTA ENGIL	1,790	-5,49	-51,13
NAVIGATOR	3,900	-7,14	-7,59
NOS	4,882	-1,09	-10,93
NOVABASE	2,640	0,00	-13,41
PHAROL	0,150	-4,83	-40,16
REN	2,360	-0,34	-4,80
SEMAPA	16,060	-4,63	-9,75
SONAE CAP.	0,766	-4,25	-13,64
SONAE SGPS	0,852	-2,85	-24,38
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	0,04
PHAROL	-4,83
CTT	-4,95
MOTA ENGIL	-5,49
NAVIGATOR	-7,14
ALTRI	-10,83



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.046,09	-2,00%	-6,35%	5.801,45	5.044,23
CAC40	5.214,23	-1,96%	-1,85%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.272,93	-1,47%	-6,59%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	11.735,12	-2,02%	-9,15%	13.596,89	11.712,27
S&P 500	2.839,42	-1,41%	6,21%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	9.177,80	-0,89%	-8,62%	10.643,40	9.111,10
NIKKEI 225	23.506,04	0,16%	3,26%	24.448,07	20.347,49



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.