

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

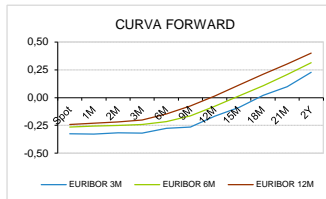
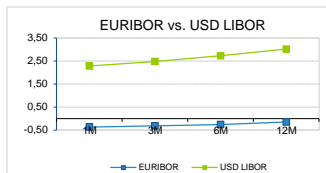
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

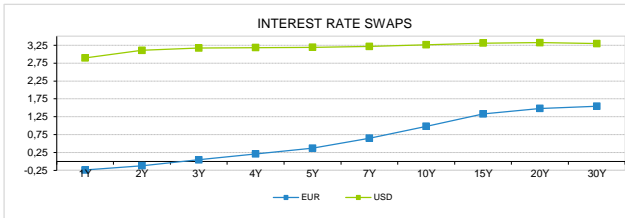
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,2819	0	10	0,7259	-0,7842
3M	-0,3170	0	0	3M	2,4772	1	12	0,8035	-0,7464
6M	-0,2610	0	1	6M	2,7235	3	15	0,9053	-0,6676
12M	-0,1510	0	2	12M	3,0204	2	13	1,0686	-0,5356

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2410	0	1	0,0148	0,7500	1,2820
2Y	-0,1180	0	1	0,2068	0,8910	1,3900
3Y	0,0450	-1	1	0,3865	1,0210	1,4850
4Y	0,2120	-2	1	0,5470	1,1385	1,5700
5Y	0,3670	-3	1	0,6920	1,2445	1,6440
7Y	0,6470	-3	1	0,9420	1,4235	1,7704
10Y	0,9810	-4	0	1,2280	1,6099	1,8640
15Y	1,3290	-3	0	1,4951	1,7530	1,9170
20Y	1,4840	-3	-1	1,6051	1,7840	1,8830
30Y	1,5420	-3	-2	1,6170	1,7310	1,7920

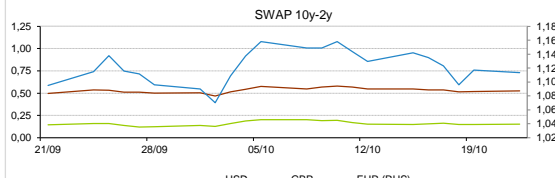
TAXA DE REFERENCIA		BANCO CENTRAL
Zona Euro	0,00	
EUA	2,25	
Reino Unido	0,75	
Japão	0,10	
Canadá	1,50	
Suíça	-0,75	
China	5,75	
Brasil	6,50	
Austrália	1,50	
Índia	4,00	



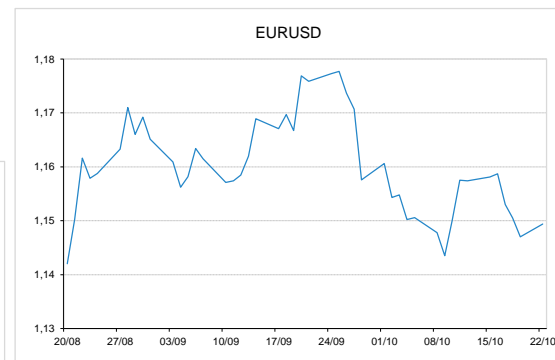
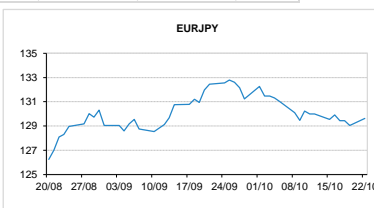
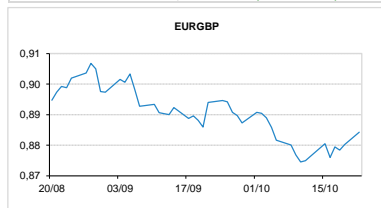
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8940	0	14	3,2959	3,2110	3,2180
2Y	3,1060	-1	13	3,2760	3,2000	3,2500
3Y	3,1690	-2	13	3,2520	3,2010	3,2928
4Y	3,1850	-2	12	3,2410	3,2095	3,2870
5Y	3,1910	-2	11	3,2370	3,2265	3,3348
7Y	3,2160	-1	12	3,2425	3,2655	3,3235
10Y	3,2610	-1	12	3,2890	3,2995	3,3530
15Y	3,3100	-1	13	3,3075	3,3165	3,3300
20Y	3,3200	0	13	3,3030	3,2990	3,3060
30Y	3,2940	0	13	3,2680	3,2755	3,2560



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	79,75	-0,03	1,51	OT 2Y	-0,094	-0,03	-1,00
JETFUEL	763,75	-0,25	38,25	OT 5Y	0,841	-0,02	12,10
DIESEL	721,00	1,50	32,50	OT 10Y	2,013	-0,01	13,00
COBRE	6.222,00	63,00	99,00	BUND 10Y	0,054	0,83	-4,10
ZINCO	2.676,50	-59,00	241,00	SCHATZ 2Y	0,044	1,61	-4,80
OURO	1.221,67	-5,73	24,34	T-NOTE 10Y	3,814	-0,86	6,10
TRIGO	508,25	-6,50	-13,50	T-NOTE 2Y	3,279	-0,79	5,10
LICENÇA C02	19,03	-0,68	-3,10	GILT 10Y	1,660	-3,41	-6,30


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1494	0,21%	-2,37%	1,1589	1,1681	1,1885
EUR/GBP	0,88425	-0,46%	1,17%	0,8872	0,8903	0,8969
EUR/JPY	129,63	-0,45%	2,26%	129,63	129,63	129,63
EUR/CHF	1,1424	0,39%	-0,91%	1,1411	1,1400	1,1376
EUR/BRL	4,2237	1,16%	13,77%	4,2876	4,3556	4,5172
EUR/PLN	4,2908	0,08%	0,09%	4,3143	4,3369	4,3859

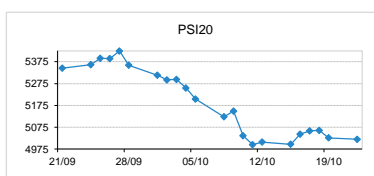

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1494	0,8843	129,63	1,1424	10,3109	7,4609	1,5030	1,6181	4,2237	9,4633
USD	0,8718	-	0,7707	112,855	0,9971	8,9994	6,5043	1,3096	1,4105	3,6749	8,2596

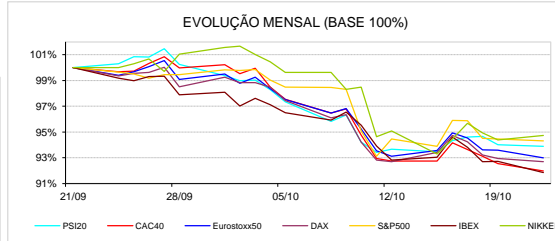
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,440	0,54	43,88
BCP	0,225	0,49	-17,24
CORT. AMORIM	9,920	0,40	-3,69
CTT	3,180	-0,63	-9,32
EDP	3,145	-0,76	9,01
EDP R	8,100	-0,67	16,26
GALP	15,675	0,22	2,28
IBERSOL	8,660	-1,37	-14,47
J MARTINS	11,315	-1,18	-30,13
MOTA ENIGL	1,770	-1,78	-51,68
NAVIGATOR	4,142	0,98	-1,85
NOS	5,150	0,19	-6,04
NOVABASE	2,500	0,81	-18,01
PHAROL	0,143	-1,11	-42,80
REN	2,356	-0,17	-4,96
SEMAPA	16,400	-0,61	-7,84
SONAE CAP.	0,733	-0,14	-17,36
SONAE SGPS	0,857	0,88	-23,89

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NAVIGATOR	0,98
SONAE SGPS	0,88
NOVABASE	0,81
ALTRI	0,54
BCP	0,49
EDP	-0,76
PHAROL	-1,11
J MARTINS	-1,18
IBERSOL	-1,37
MOTA ENIGL	-1,78



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.019,07	-0,14%	-6,85%	5.801,45	4.962,72
CAC40	5.053,31	-0,62%	-4,88%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.190,21	-0,64%	-8,95%	3.708,82	3.180,61
XTRA DAX	11.524,34	-0,26%	-10,79%	13.596,89	11.459,08
S&P 500	2.763,35	-0,17%	3,35%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.809,80	-0,93%	-12,29%	10.643,40	8.768,70
NIKKEI 225	22.614,82	0,37%	-0,66%	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.