

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

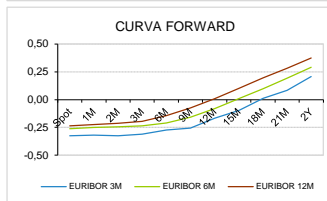
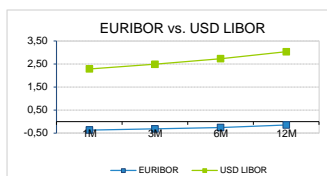
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

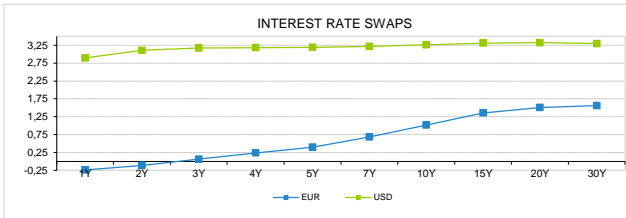
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,2865	0	7	0,7244	-0,7842
3M	-0,3170	0	0	3M	2,4874	1	11	0,8046	-0,7404
6M	-0,2590	0	1	6M	2,7293	1	14	0,9087	-0,6636
12M	-0,1490	0	2	12M	3,0310	1	12	1,0716	-0,5318

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2349	1	1	0,0056	0,7160	1,2430
2Y	-0,1080	1	2	0,1894	0,8570	1,3530
3Y	0,0630	2	3	0,3649	0,9853	1,4480
4Y	0,2400	3	4	0,5222	1,1030	1,5330
5Y	0,4010	3	5	0,6640	1,2080	1,6080
7Y	0,6840	4	5	0,9108	1,3870	1,7260
10Y	1,0170	4	5	1,1959	1,5723	1,8340
15Y	1,3580	3	3	1,4628	1,7175	1,8870
20Y	1,5090	3	2	1,5740	1,7510	1,8540
30Y	1,5590	2	0	1,5881	1,7025	1,7650

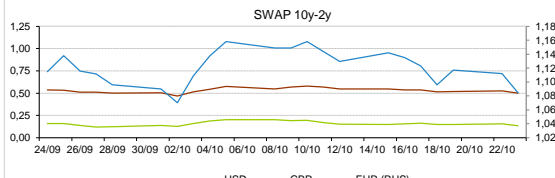
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



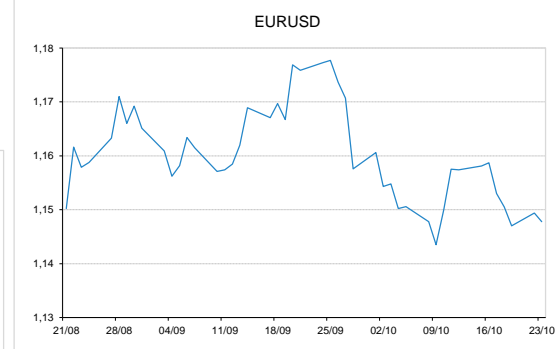
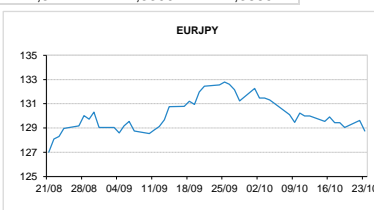
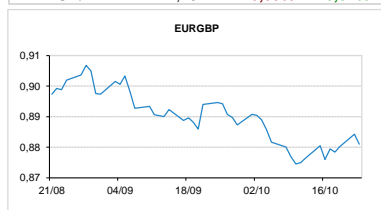
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8940	0	14	3,2213	3,1210	3,1530
2Y	3,1060	-1	13	3,1970	3,1120	3,1785
3Y	3,1690	-2	13	3,1720	3,1504	3,2020
4Y	3,1850	-2	12	3,1735	3,1690	3,2250
5Y	3,1910	-2	11	3,1747	3,1885	3,2733
7Y	3,2160	-1	12	3,1946	3,2070	3,2770
10Y	3,2610	-1	12	3,2190	3,2707	3,3196
15Y	3,3100	-1	13	3,2525	3,2660	3,3141
20Y	3,3200	0	13	3,2752	3,2510	3,2575
30Y	3,2940	0	13	3,2437	3,2385	3,2385



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	76,84	-2,99	-1,40	OT 2Y	-0,096	0,00	-0,30
JETFUEL	749,25	-14,50	23,75	OT 5Y	0,832	-0,01	12,70
DIESEL	708,25	-12,75	19,75	OT 10Y	2,006	-0,01	13,70
COBRE	6.228,50	22,00	-121,00	BUND 10Y	0,013	-3,70	-6,20
ZINCO	2.715,00	38,50	207,25	SCHATZ 2Y	0,025	-1,61	-6,20
OURO	1.233,47	11,18	36,14	T-NOTE 10Y	3,754	-6,32	1,00
TRIGO	507,75	-0,25	-14,00	T-NOTE 2Y	3,228	-5,11	2,00
LICENÇA C02	19,20	0,20	-2,93	GILT 10Y	1,609	-4,27	-7,80


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1478	-0,14%	-2,51%	1,1573	1,1665	1,1867
EUR/GBP	0,88103	0,37%	1,54%	0,8840	0,8870	0,8935
EUR/JPY	128,76	0,68%	2,95%	128,76	128,76	128,76
EUR/CHF	1,1418	0,12%	-0,85%	1,1406	1,1394	1,1370
EUR/BRL	4,255	-0,66%	12,94%	4,3193	4,3859	4,5472
EUR/PLN	4,2941	-0,03%	0,01%	4,3174	4,3399	4,3885

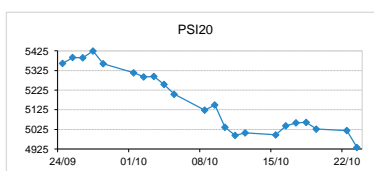

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1478	0,8810	128,76	1,1418	10,3758	7,4602	1,5044	1,6235	4,2550	9,5288
USD	0,8728	-	0,7707	112,115	0,9953	9,0446	6,5110	1,3107	1,4165	3,7141	8,2987

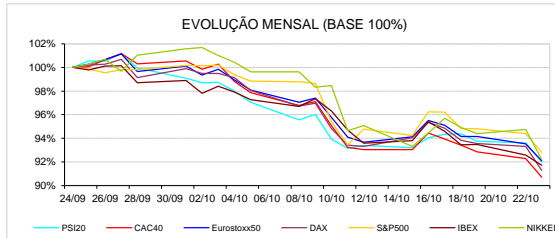
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,140	-4,03	38,08
BCP	0,223	-1,02	-18,09
CORT. AMORIM	9,620	-3,02	-6,60
CTT	3,160	-0,63	-9,89
EDP	3,101	-1,40	7,49
EDP R	7,940	-1,98	13,97
GALP	15,070	-3,86	-1,66
IBERSOL	8,540	-1,39	-15,65
J MARTINS	11,465	1,33	-29,21
MOTA ENGIL	1,696	-4,18	-53,70
NAVIGATOR	4,052	-2,17	-3,98
NOS	5,055	-1,84	-7,77
NOVABASE	2,480	-0,80	-18,66
PHAROL	0,139	-2,52	-44,24
REN	2,330	-1,10	-6,01
SEMAPA	15,900	-3,05	-10,65
SONAE CAP.	0,734	0,14	-17,25
SONAE SGPS	0,855	-0,23	-24,07

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
J MARTINS	1,33
SONAE CAP.	0,14
CORT. AMORIM	-3,02
SEMAPA	-3,05
GALP	-3,86
ALTRI	-4,03
MOTA ENGIL	-4,18



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.932,55	-1,72%	-8,46%	5.801,45	4.932,55
CAC40	4.967,69	-1,69%	-6,49%	5.657,44	4.955,67
ESTX 50 PR	3.140,94	-1,54%	-10,36%	3.708,82	3.132,29
XTRA DAX	11.274,28	-2,17%	-12,72%	13.596,89	11.228,50
S&P 500	2.708,60	-1,68%	1,34%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.726,10	-0,91%	-13,12%	10.643,40	8.681,90
NIKKEI 225	22.010,78	-2,67%	-3,31%	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.