

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

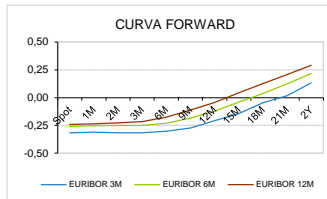
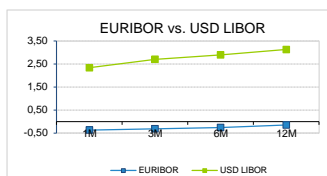
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

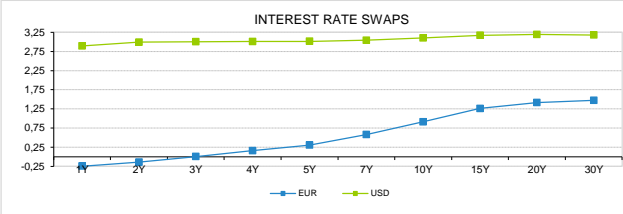
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,3368	1	4	0,7355	-0,7868
3M	-0,3160	0	0	3M	2,7068	2	19	0,8921	-0,7432
6M	-0,2560	0	0	6M	2,8928	1	12	1,0034	-0,6702
12M	-0,1460	0	0	12M	3,1284	1	7	1,1409	-0,5332

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2428	0	0	-0,0431	0,6179	1,1566
2Y	-0,1390	0	-1	0,1231	0,7576	1,2667
3Y	0,0070	0	-2	0,2874	0,8870	1,3681
4Y	0,1600	0	-3	0,4386	1,0070	1,4591
5Y	0,3070	0	-4	0,5790	1,1180	1,5409
7Y	0,5790	0	-4	0,8290	1,3095	1,6692
10Y	0,9110	0	-4	1,1242	1,5052	1,7879
15Y	1,2610	0	-4	1,4055	1,6654	1,8525
20Y	1,4170	0	-3	1,5269	1,7072	1,8214
30Y	1,4710	-1	-3	1,5502	1,6685	1,7381

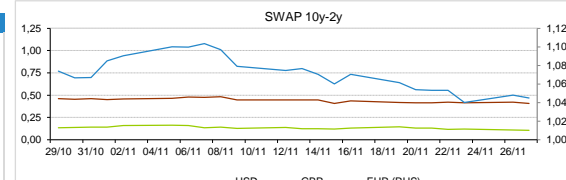
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



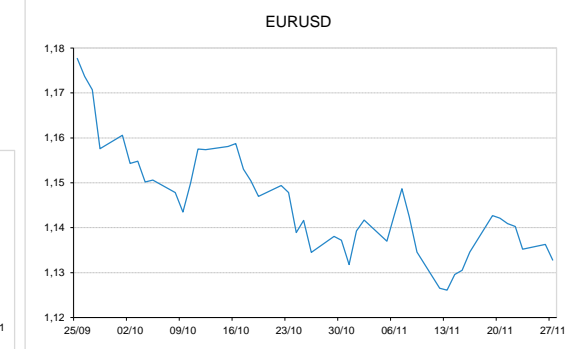
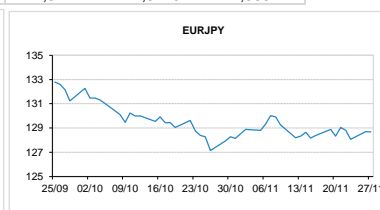
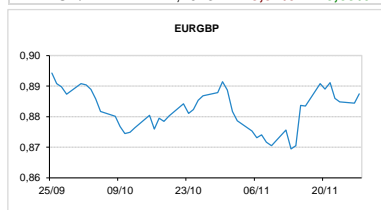
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8940	-1	3	3,1020	3,0335	3,0800
2Y	2,9900	-2	-6	3,0788	3,0415	3,0980
3Y	3,0040	-3	-10	3,0659	3,0490	3,1350
4Y	3,0080	-3	-10	3,0626	3,0675	3,1640
5Y	3,0140	-3	-10	3,0550	3,0930	3,2208
7Y	3,0410	-4	-10	3,0830	3,1440	3,2616
10Y	3,1030	-4	-9	3,1460	3,1990	3,2860
15Y	3,1730	-4	-7	3,1980	3,2180	3,2545
20Y	3,1930	-4	-6	3,2255	3,2165	3,2430
30Y	3,1810	-4	-5	3,2055	3,2104	3,2181



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	60,46	-0,02	-17,20	OT 2Y	-0,202	-0,02	-7,80
JETFUEL	623,25	-9,59	-133,00	OT 5Y	0,668	-0,01	-5,10
DIESEL	585,00	-7,25	-133,50	OT 10Y	1,882	0,00	-2,40
COBRE	6.172,50	-18,00	29,00	BUND 10Y	-0,073	-1,72	-0,80
ZINCO	2.532,00	-37,50	-143,00	SCHATZ 2Y	0,014	-0,92	2,80
OURO	1.212,85	-9,70	-21,09	T-NOTE 10Y	3,692	-0,17	-1,30
TRIGO	507,50	-6,50	-16,75	T-NOTE 2Y	3,177	0,39	1,20
LICENÇA C02	19,58	-0,25	1,30	GILT 10Y	1,513	-1,92	0,90


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1328	-0,31%	-0,47%	1,1422	1,1512	1,1709
EUR/GBP	0,88748	-0,35%	0,05%	0,8906	0,8937	0,9005
EUR/JPY	128,66	0,03%	-0,58%	128,66	128,66	128,66
EUR/CHF	1,1279	0,35%	1,11%	1,1268	1,1256	1,1231
EUR/BRL	4,3929	1,42%	-3,67%	4,4586	4,5243	4,6837
EUR/PLN	4,2973	-0,01%	0,63%	4,3211	4,3445	4,3937

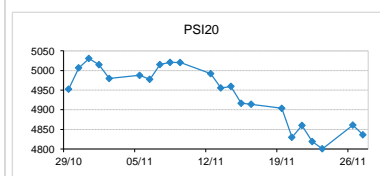

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1328	0,8875	128,66	1,1279	10,2845	7,4612	1,5024	1,56598	4,3929	9,7297
USD	0,8857	-	0,7847	113,785	0,9990	9,1017	6,6082	1,3282	1,3848	3,8880	8,6071

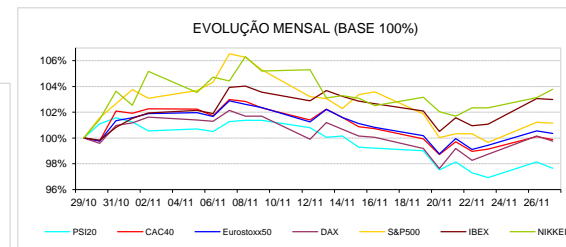
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	6,530	-2,68	26,28
BCP	0,241	-0,29	-11,43
CORT. AMORIM	9,310	-0,21	-9,61
CTT	3,400	1,31	-3,05
EDP	3,070	-0,23	6,41
EDP R	7,610	-0,20	9,23
GALP	14,405	-1,06	-6,00
IBERSOL	8,100	0,00	-20,00
J MARTINS	10,540	-0,57	-34,92
MOTA ENGIL	1,812	11,17	-50,53
NAVIGATOR	3,604	-2,59	-14,60
NOS	5,190	0,48	-5,31
NOVABASE	2,380	0,00	-21,94
PHAROL	0,175	0,00	-30,00
REN	2,364	-1,83	-4,64
SEMAPA	13,860	-2,53	-22,11
SONAE CAP.	0,747	-2,10	-15,78
SONAE SGPS	0,845	0,54	-24,96

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	11,17
CTT	1,31
SONAE SGPS	0,54
NOS	0,48
REN	-1,83
SONAE CAP.	-2,10
SEMAPA	-2,53
NAVIGATOR	-2,59
ALTRI	-2,68



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.836,18	-0,51%	-10,25%	5.801,45	4.783,34
CAC40	4.983,15	-0,24%	-6,20%	5.657,44	4.894,30
ESTX 50 PR	3.166,42	-0,20%	-9,63%	3.687,22	3.090,85
XTRA DAX	11.309,11	-0,40%	-12,45%	13.596,89	11.009,25
S&P 500	2.671,53	-0,07%	-0,08%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	9.085,60	-0,06%	-9,54%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	21.952,40	0,64%	-3,57%	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.