

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

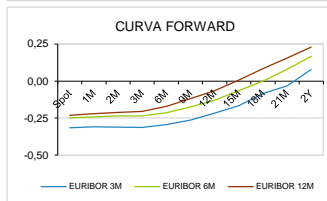
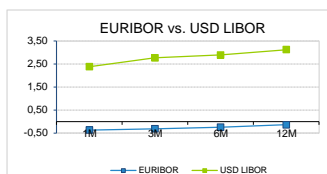
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

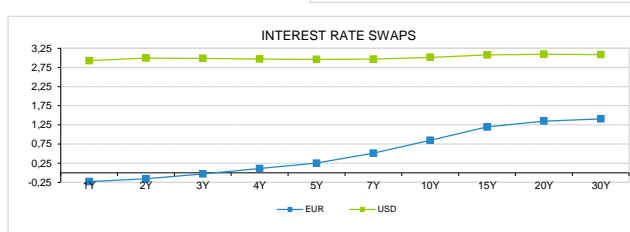
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,3833	0	7	0,7358	-0,8360
3M	-0,3150	0	0	3M	2,7658	3	18	0,8976	-0,7398
6M	-0,2460	0	1	6M	2,8911	-1	6	1,0228	-0,6606
12M	-0,1400	0	1	12M	3,1258	-1	1	1,1599	-0,5248

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2304	0	1	-0,0646	0,5340	1,0680
2Y	-0,1560	0	-3	0,0830	0,6765	1,1790
3Y	-0,0300	-1	-7	0,2320	0,8060	1,2815
4Y	0,1100	-1	-10	0,3780	0,9260	1,3755
5Y	0,2510	-1	-11	0,5145	1,0370	1,4560
7Y	0,5130	-2	-13	0,7595	1,2290	1,5870
10Y	0,8450	-2	-14	1,0545	1,4300	1,7050
15Y	1,1960	-3	-13	1,3362	1,5925	1,7640
20Y	1,3520	-3	-13	1,4522	1,6268	1,7335
30Y	1,4070	-3	-13	1,4709	1,5820	1,6480

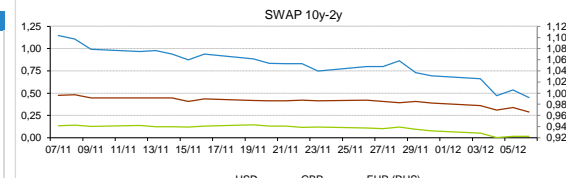
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



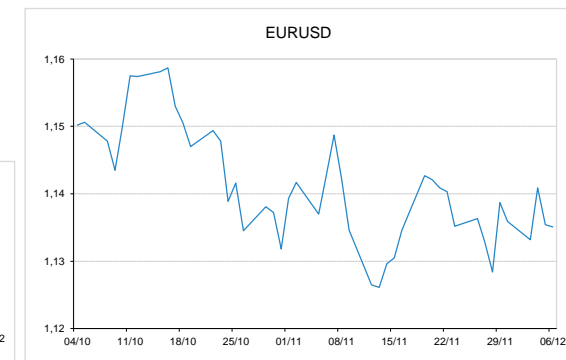
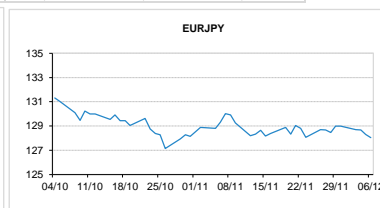
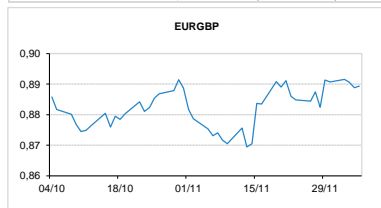
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,9240	0	-1	2,9719	2,7340	2,8410
2Y	2,9940	0	-10	2,8155	2,8029	2,8445
3Y	2,9890	-1	-15	2,7900	2,7740	2,8775
4Y	2,9730	-1	-18	2,7830	2,7955	2,9230
5Y	2,9600	-2	-20	2,7920	2,8235	2,9820
7Y	2,9680	-3	-22	2,8210	2,8885	2,9930
10Y	3,0140	-4	-23	2,9338	2,9525	3,0340
15Y	3,0790	-5	-23	2,9560	2,9935	3,0460
20Y	3,0980	-6	-23	2,9745	2,9925	3,0270
30Y	3,0870	-6	-22	2,9615	2,9695	3,0090



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	58,95	-2,61	-13,21	OT 2Y	-0,230	0,00	-8,50
JETFUEL	593,69	-28,66	-116,33	OT 5Y	0,574	0,01	-13,20
DIESEL	552,69	-28,66	-118,33	OT 10Y	1,809	0,01	-8,90
COBRE	6.193,50	-34,00	-16,00	BUND 10Y	-0,260	-4,77	-22,70
ZINCO	2.685,00	39,00	151,50	SCHATZ 2Y	0,018	-2,07	-7,20
OURO	1.242,11	3,62	16,00	T-NOTE 10Y	3,530	-6,86	-31,50
TRIGO	514,00	-4,00	-13,25	T-NOTE 2Y	3,035	-10,58	-28,70
LICENÇA C02	19,87	0,20	2,30	GILT 10Y	1,446	-7,27	-29,50


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1351	-0,03%	-0,67%	1,1444	1,1536	1,1725
EUR/GBP	0,8893	-0,05%	-1,82%	0,8923	0,8955	0,9022
EUR/JPY	128,04	0,21%	0,99%	128,04	128,04	128,04
EUR/CHF	1,1289	0,30%	1,45%	1,1276	1,1264	1,1241
EUR/BRL	4,4523	-1,58%	-3,54%	4,5146	4,5847	4,7384
EUR/PLN	4,2804	0,06%	0,54%	4,3044	4,3281	4,3747

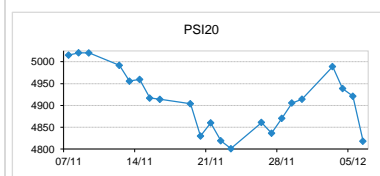

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1351	0,8893	128,04	1,1289	10,2430	7,4636	1,5262	1,57669	4,4523	9,7095
USD	0,8784	-	0,7826	112,335	0,9918	9,0018	6,5561	1,3425	1,3861	3,9207	8,5325

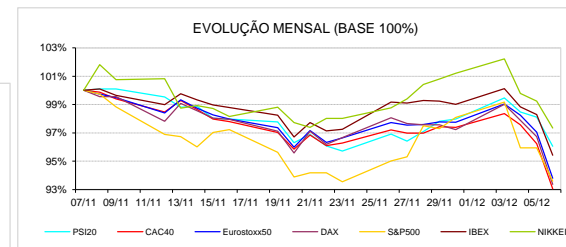
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,910	-3,11	14,29
BCP	0,243	-2,57	-10,85
CORT. AMORIM	9,400	-2,19	-8,74
CTT	3,350	-4,29	-4,48
EDP	3,020	-2,64	4,68
EDP R	7,660	-2,11	9,95
GALP	14,270	-3,35	-6,88
IBERSOL	8,080	-0,74	-20,20
J MARTINS	10,260	-2,43	-36,65
MOTA ENGIL	1,622	-4,02	-55,72
NAVIGATOR	3,700	-0,05	-12,33
NOS	5,370	-0,37	-2,03
NOVABASE	2,250	-5,46	-26,21
PHAROL	0,180	-2,28	-28,08
REN	2,406	-0,74	-2,94
SEMAPA	13,760	-2,27	-22,67
SONAE CAP.	0,823	0,98	-7,22
SONAE SGPS	0,813	-2,05	-27,84

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE CAP.	0,98
ALTRI	-3,11
GALP	-3,35
MOTA ENGIL	-4,02
CTT	-4,29
NOVABASE	-5,46



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.817,69	-2,10%	-10,59%	5.801,45	4.783,34
CAC40	4.780,46	-3,32%	-10,02%	5.657,44	4.760,98
ESTX 50 PR	3.045,16	-3,34%	-13,09%	3.687,22	3.033,78
XTRA DAX	10.810,98	-3,48%	-16,31%	13.596,89	10.762,41
S&P 500	2.634,46	-2,45%	-1,49%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.749,20	-2,92%	-12,89%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	21.501,62	-1,91%	-5,55%	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.