

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

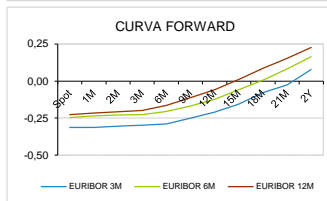
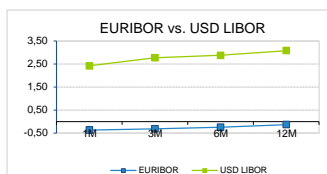
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

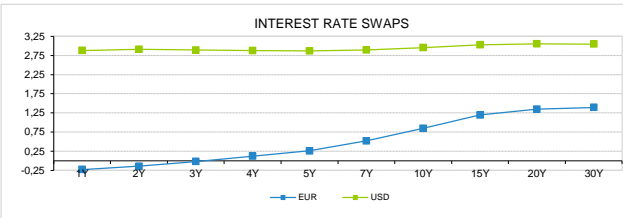
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4205	2	11	0,7369	-0,8316
3M	-0,3120	0	0	3M	2,7759	0	16	0,9070	-0,7406
6M	-0,2440	0	1	6M	2,8779	-1	2	1,0284	-0,6646
12M	-0,1310	0	2	12M	3,0840	-2	-6	1,1518	-0,5260

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2261	0	1	-0,0620	0,5403	1,0778
2Y	-0,1420	0	-3	0,0809	0,6790	1,1961
3Y	-0,0180	0	-7	0,2332	0,8127	1,3035
4Y	0,1210	0	-9	0,3819	0,9365	1,3974
5Y	0,2590	-1	-11	0,5182	1,0526	1,4800
7Y	0,5190	-1	-13	0,7702	1,2470	1,6110
10Y	0,8470	-1	-13	1,0680	1,4428	1,7239
15Y	1,1950	-2	-13	1,3424	1,5926	1,7715
20Y	1,3460	-2	-13	1,4534	1,6267	1,7392
30Y	1,3940	-3	-13	1,4674	1,5801	1,6471

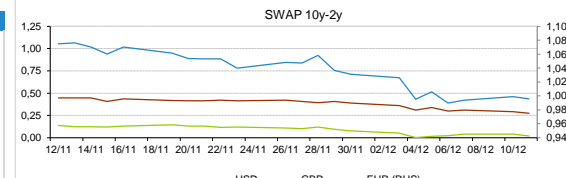
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suiza	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



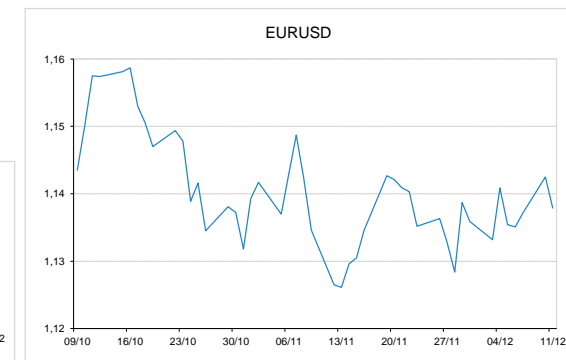
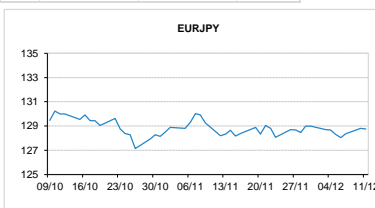
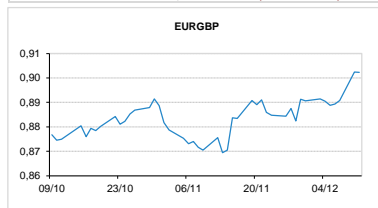
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8790	3	-7	2,8957	2,7305	2,8080
2Y	2,9110	4	-21	2,7920	2,7420	2,8470
3Y	2,8910	4	-27	2,7720	2,7625	2,8775
4Y	2,8760	5	-30	2,7675	2,7925	2,9170
5Y	2,8700	5	-31	2,7765	2,8215	2,9721
7Y	2,8930	5	-31	2,8120	2,8810	2,9865
10Y	2,9540	6	-30	2,8840	2,9405	3,0110
15Y	3,0300	6	-28	2,9380	2,9745	3,0160
20Y	3,0540	6	-27	2,9520	2,9710	2,9960
30Y	3,0470	5	-25	2,9340	2,9390	2,9480



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	60,22	0,25	-10,17	OT 2Y	-0,280	-0,03	-12,30
JETFUEL	605,20	-2,85	-96,36	OT 5Y	0,518	-0,02	-22,60
DIESEL	562,45	-3,85	-98,61	OT 10Y	1,757	-0,03	-18,70
COBRE	6.095,00	-56,00	33,00	BUND 10Y	-0,258	-0,59	-19,90
ZINCO	2.625,50	-23,50	80,50	SCHATZ 2Y	0,048	-2,07	-3,50
OURO	1.243,93	0,45	35,61	T-NOTE 10Y	3,527	-0,33	-30,10
TRIGO	518,00	-7,25	5,75	T-NOTE 2Y	3,035	0,00	-28,70
LICENÇA C02	20,16	-0,70	0,66	GILT 10Y	1,403	0,66	-30,50


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1379	-0,40%	1,01%	1,1471	1,1562	1,1749
EUR/GBP	0,90228	0,02%	-2,95%	0,9052	0,9085	0,9151
EUR/JPY	128,75	0,03%	-0,43%	128,75	128,75	128,75
EUR/CHF	1,1236	0,10%	0,94%	1,1224	1,1213	1,1190
EUR/BRL	4,4318	0,51%	-4,48%	4,4943	4,5644	4,7113
EUR/PLN	4,3016	-0,14%	-0,04%	4,3251	4,3491	4,3969

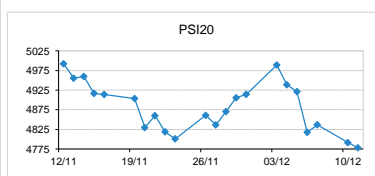

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1379	0,9023	128,75	1,1236	10,2888	7,4644	1,5184	1,57259	4,4318	9,7123
USD	0,8829	-	0,7973	113,315	0,9919	9,0892	6,5900	1,3412	1,3884	3,9112	8,5680

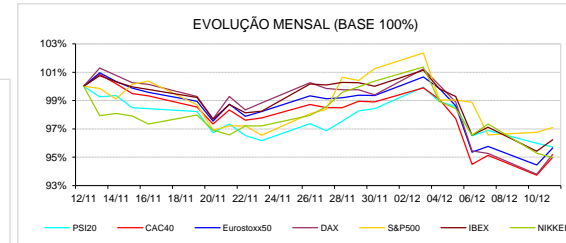
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	5,690	0,18	10,04
BCP	0,240	-0,12	-11,62
CORT. AMORIM	9,340	1,30	-9,32
CTT	3,176	-3,99	-9,44
EDP	3,110	1,77	7,80
EDP R	7,655	0,33	9,88
GALP	14,305	0,07	-6,66
IBERSOL	8,200	-0,73	-19,01
J MARTINS	10,140	-4,16	-37,39
MOTA ENGIL	1,572	1,68	-57,08
NAVIGATOR	3,536	0,00	-16,21
NOS	5,250	0,00	-4,21
NOVABASE	2,360	0,43	-22,60
PHAROL	0,179	-0,67	-28,56
REN	2,398	0,25	-3,27
SEMAPA	13,040	0,93	-26,72
SONAE CAP.	0,876	0,69	-1,24
SONAE SGPS	0,800	-2,26	-28,95

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP	1,77
MOTA ENGIL	1,68
CORT. AMORIM	1,30
SEMAPA	0,93
SONAE CAP.	0,69
PHAROL	-0,67
IBERSOL	-0,73
SONAE SGPS	-2,26
CTT	-3,99
J MARTINS	-4,16



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.778,06	-0,28%	-11,33%	5.801,45	4.778,06
CAC40	4.806,20	1,35%	-9,53%	5.657,44	4.732,02
ESTX 50 PR	3.055,32	1,27%	-12,80%	3.687,22	3.007,53
XTRA DAX	10.780,51	1,49%	-16,54%	13.596,89	10.585,77
S&P 500	2.647,37	0,35%	-0,99%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.735,50	0,87%	-13,03%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	21.148,02	-0,34%	-7,10%	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.