

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

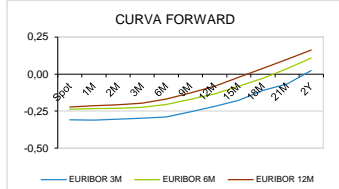
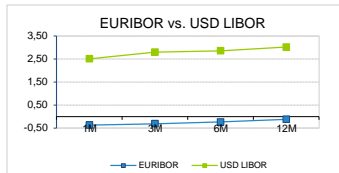
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

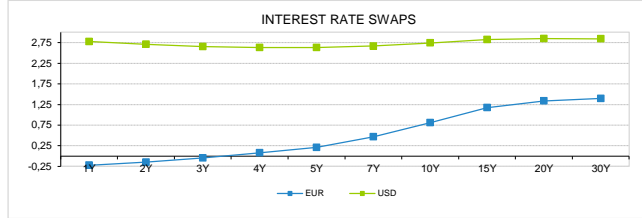
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3650	0	0	1M	2,5142	0	9	0,7321	-0,7792
3M	-0,3080	0	0	3M	2,7969	0	2	0,9176	-0,7040
6M	-0,2360	0	1	6M	2,8604	-1	-2	1,0398	-0,6294
12M	-0,1170	0	1	12M	3,0190	-2	-7	1,1839	-0,4904

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2210	0	1	-0,0830	0,4390	0,9970
2Y	-0,1490	-1	-1	0,0400	0,5790	1,1210
3Y	-0,0430	-1	-3	0,1720	0,7180	1,2370
4Y	0,0800	-2	-4	0,3080	0,8480	1,3370
5Y	0,2100	-2	-5	0,4440	0,9710	1,4270
7Y	0,4690	-2	-5	0,7000	1,1770	1,5660
10Y	0,8090	-2	-4	1,0100	1,3996	1,6930
15Y	1,1750	-2	-2	1,3132	1,5727	1,7580
20Y	1,3370	-1	-1	1,4337	1,6123	1,7290
30Y	1,3960	-1	0	1,4570	1,5700	1,6440

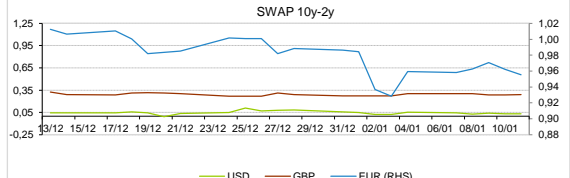
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



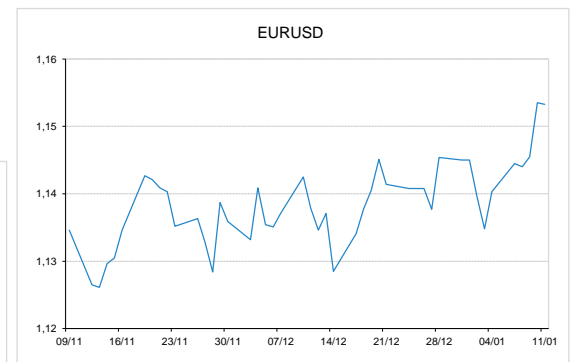
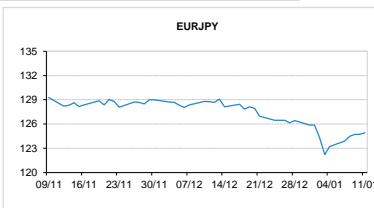
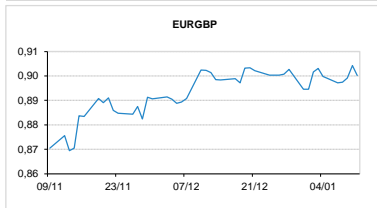
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7770	1	-10	2,6177	2,5095	2,6690
2Y	2,7110	1	-20	2,5541	2,5495	2,6910
3Y	2,6530	1	-24	2,5453	2,5685	2,7340
4Y	2,6290	2	-25	2,5245	2,6499	2,7890
5Y	2,6310	2	-24	2,5485	2,6680	2,8482
7Y	2,6660	2	-23	2,6270	2,7240	2,8790
10Y	2,7430	2	-21	2,7205	2,8367	2,9110
15Y	2,8250	1	-21	2,7890	2,8580	2,9030
20Y	2,8490	2	-21	2,8215	2,8490	2,9000
30Y	2,8430	1	-20	2,8050	2,8260	2,8480



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	60,76	-0,92	0,41	OT 2Y	-0,189	-0,01	11,20
JETFUEL	617,25	9,00	9,20	OT 5Y	0,468	-0,01	-2,70
DIESEL	574,13	10,13	7,83	OT 10Y	1,705	-0,01	-1,70
COBRE	5.916,50	-28,00	-159,00	BUND 10Y	-0,327	-1,53	-10,50
ZINCO	2.475,50	-35,00	-114,00	SCHATZ 2Y	0,037	0,46	-3,60
OURO	1.289,47	1,43	45,10	T-NOTE 10Y	3,395	-2,31	-18,00
TRIGO	522,50	8,75	1,50	T-NOTE 2Y	2,875	-1,95	-20,70
LICENÇA C02	22,69	0,58	2,18	GILT 10Y	1,527	2,78	5,10


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1533	-0,02%	1,35%	1,1622	1,1713	1,1899
EUR/GBP	0,90015	0,45%	0,24%	0,9030	0,9062	0,9130
EUR/JPY	124,91	-0,17%	3,07%	124,91	124,91	124,91
EUR/CHF	1,1281	0,25%	-0,33%	1,1271	1,1260	1,1235
EUR/BRL	4,259	0,19%	3,70%	4,3200	4,3826	4,5205
EUR/PLN	4,2945	-0,03%	0,16%	4,3180	4,3420	4,3901

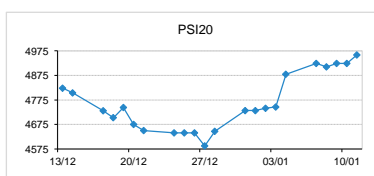

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1533	0,9002	124,91	1,1281	10,2519	7,4644	1,5214	1,59361	4,2590	9,7875
USD	0,8713	-	0,7801	108,425	0,9830	8,9252	6,5035	1,3256	1,3890	3,7120	8,5126

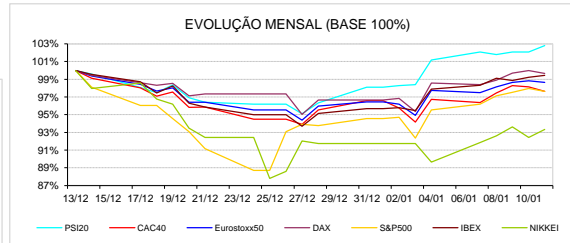
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	6,280	0,80	8,28
BCP	0,244	-0,41	6,49
CORT. AMORIM	9,460	-0,21	5,11
CTT	3,070	0,72	4,21
EDP	3,085	0,75	1,18
EDP R	7,970	1,40	2,51
GALP	14,650	1,07	6,20
IBERSOL	8,720	0,69	10,38
J MARTINS	10,690	0,09	3,38
MOTA ENGIL	1,766	2,56	9,69
NAVIGATOR	3,872	1,68	7,56
NOS	5,450	1,02	2,93
NOVABASE	2,060	-0,48	1,98
PHAROL	0,186	-0,53	13,97
REN	2,544	0,16	4,52
SEMAPA	14,460	0,98	10,38
SONAE CAP.	0,865	0,35	1,88
SONAE SGPS	0,859	1,54	5,99

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	2,56
NAVIGATOR	1,68
SONAE SGPS	1,54
EDP R	1,40
GALP	1,07
CORT. AMORIM	-0,21
BCP	-0,41
NOVABASE	-0,48
PHAROL	-0,53



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.958,61	0,71%	4,80%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.781,34	-0,51%	1,07%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.070,04	-0,18%	2,29%	3.687,22	2.908,70
XTRA DAX	10.887,46	-0,31%	3,11%	13.596,89	10.279,20
S&P 500	2.588,17	-0,35%	3,22%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	8.877,10	0,23%	3,95%	10.643,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.359,70	0,97%	1,72%	24.448,07	18.948,58



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.