

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

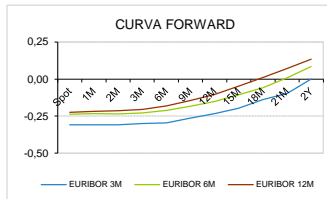
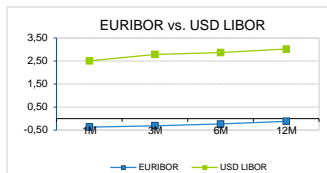
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

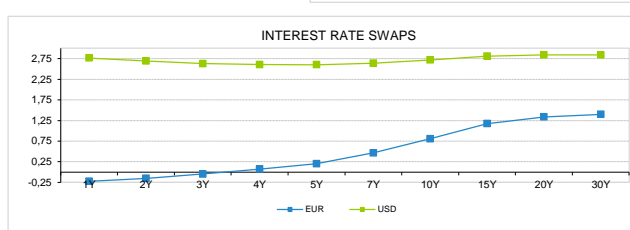
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,5089	-1	8	0,7327	-0,7812
3M	-0,3080	0	0	3M	2,7873	-1	1	0,9197	-0,7024
6M	-0,2360	0	0	6M	2,8646	0	-2	1,0434	-0,6346
12M	-0,1180	0	1	12M	3,0187	0	-7	1,1876	-0,4996

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2249	0	0	-0,1059	0,4224	0,9947
2Y	-0,1530	0	-2	0,0147	0,5656	1,1195
3Y	-0,0480	-1	-4	0,1496	0,7076	1,2383
4Y	0,0740	-1	-6	0,2870	0,8409	1,3406
5Y	0,2040	-1	-8	0,4270	0,9652	1,4240
7Y	0,4640	-1	-8	0,6880	1,1753	1,5692
10Y	0,8060	0	-7	1,0028	1,3903	1,6985
15Y	1,1750	0	-5	1,3011	1,5627	1,7645
20Y	1,3380	0	-3	1,4269	1,6079	1,7349
30Y	1,3990	0	-2	1,4537	1,5690	1,6484

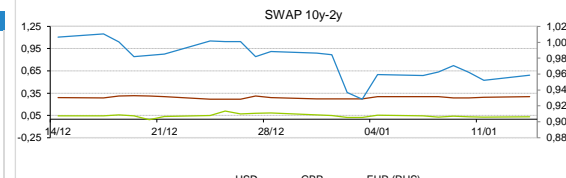
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



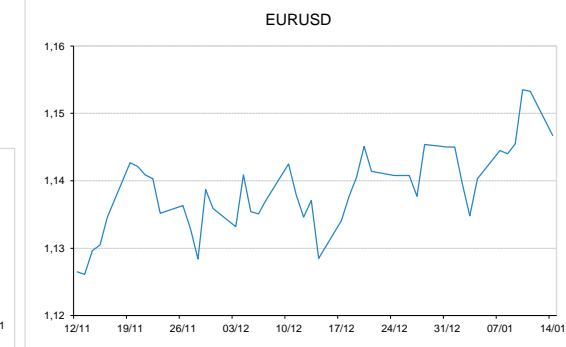
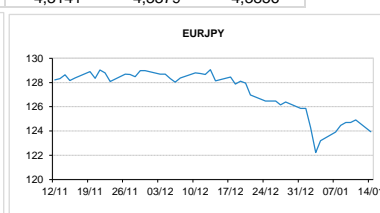
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7660	-1	-9	2,6389	2,4980	2,5418
2Y	2,6910	-1	-18	2,5330	2,3982	2,6930
3Y	2,6280	-1	-21	2,5380	2,5480	2,7365
4Y	2,6040	-2	-22	2,5610	2,6090	2,8207
5Y	2,6030	-2	-22	2,5830	2,6395	2,8588
7Y	2,6380	-2	-20	2,6400	2,7115	2,8540
10Y	2,7170	-2	-18	2,7569	2,8290	2,9070
15Y	2,8100	-2	-15	2,7780	2,8965	2,8975
20Y	2,8380	-2	-14	2,8020	2,9019	2,8815
30Y	2,8400	-1	-13	2,8010	2,8405	2,8995



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	59,95	-0,53	-0,45	OT 2Y	-0,192	0,00	11,40
JETFUEL	614,75	-2,50	9,55	OT 5Y	0,453	-0,02	1,20
DIESEL	570,75	-3,38	8,30	OT 10Y	1,683	-0,02	0,70
COBRE	5.957,50	12,00	-226,00	BUND 10Y	-0,330	-0,36	-11,70
ZINCO	2.498,00	22,50	-104,00	SCHATZ 2Y	0,028	-1,15	-3,60
OURO	1.290,46	0,17	50,62	T-NOTE 10Y	3,399	0,66	-17,60
TRIGO	516,75	-2,75	-13,25	T-NOTE 2Y	2,873	-0,58	-20,50
LICENÇA C02	22,54	-0,20	-1,18	GILT 10Y	1,538	1,54	5,70


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1467	-0,57%	1,61%	1,1556	1,1647	1,1835
EUR/GBP	0,89263	0,84%	0,64%	0,8955	0,8987	0,9056
EUR/JPY	123,93	0,79%	3,39%	123,93	123,93	123,93
EUR/CHF	1,1256	0,27%	0,24%	1,1246	1,1234	1,1210
EUR/BRL	4,25	0,13%	4,02%	4,3099	4,3754	4,5125
EUR/PLN	4,2908	0,07%	0,03%	4,3141	4,3379	4,3856

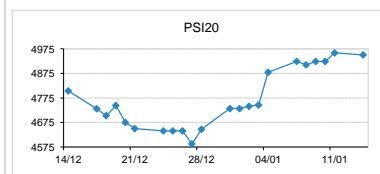

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1467	0,8926	123,93	1,1256	10,2617	7,4645	1,5238	1,59451	4,2500	9,7929
USD	0,8718	-	0,7743	108,315	0,9810	8,9459	6,5078	1,3260	1,3878	3,7152	8,5326

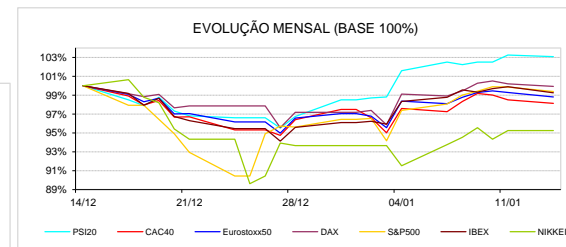
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	6,290	0,16	8,45
BCP	0,242	-1,02	5,40
CORT. AMORIM	9,440	-0,21	4,89
CTT	3,044	-0,85	3,33
EDP	3,078	-0,23	0,95
EDP R	7,930	-0,50	1,99
GALP	14,555	-0,65	5,51
IBERSOL	8,500	-2,52	7,59
J MARTINS	10,790	0,94	4,35
MOTA ENGIL	1,742	-1,36	8,20
NAVIGATOR	3,894	0,57	8,17
NOS	5,455	0,09	3,02
NOVABASE	2,070	0,49	2,48
PHAROL	0,186	-0,22	13,73
REN	2,534	-0,39	4,11
SEMAPA	14,580	0,83	11,30
SONAE CAP.	0,861	-0,46	1,41
SONAE SGPS	0,863	0,52	6,54

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
J MARTINS	0,94
SEMAPA	0,83
NAVIGATOR	0,57
SONAE SGPS	0,52
NOVABASE	0,49
GALP	-0,65
CTT	-0,85
BCP	-1,02
MOTA ENGIL	-1,36
IBERSOL	-2,52



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.950,51	-0,16%	4,63%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.762,75	-0,39%	0,68%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.055,18	-0,48%	1,79%	3.687,22	2.908,70
XTRA DAX	10.855,91	-0,29%	2,81%	13.596,89	10.279,20
S&P 500	2.585,04	-0,47%	3,08%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	8.818,60	-0,66%	3,26%	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.