

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

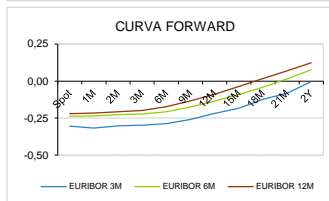
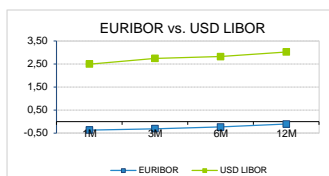
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

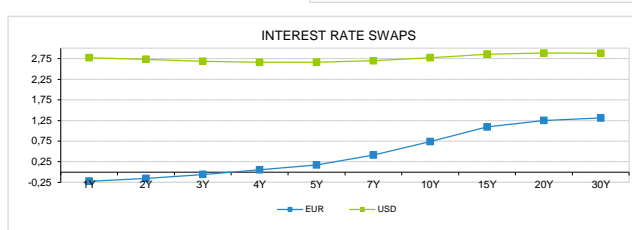
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4989	0	-2	0,7326	-0,7864
3M	-0,3080	0	0	3M	2,7444	-1	-5	0,9309	-0,6994
6M	-0,2360	0	0	6M	2,8234	-1	-5	1,0400	-0,6414
12M	-0,1090	0	1	12M	3,0238	-1	1	1,1616	-0,5124

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2210	0	1	-0,0882	0,3655	0,8677
2Y	-0,1540	0	2	0,0170	0,4934	0,9831
3Y	-0,0580	0	1	0,1325	0,6176	1,0933
4Y	0,0540	0	-1	0,2563	0,7363	1,1948
5Y	0,1730	0	-3	0,3750	0,8499	1,2760
7Y	0,4130	0	-6	0,6096	1,0503	1,4216
10Y	0,7370	0	-8	0,9049	1,2600	1,5528
15Y	1,0920	1	-8	1,1917	1,4317	1,6236
20Y	1,2520	1	-8	1,3143	1,4793	1,5945
30Y	1,3100	1	-7	1,3384	1,4405	1,5075

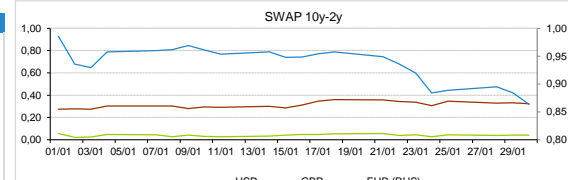
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



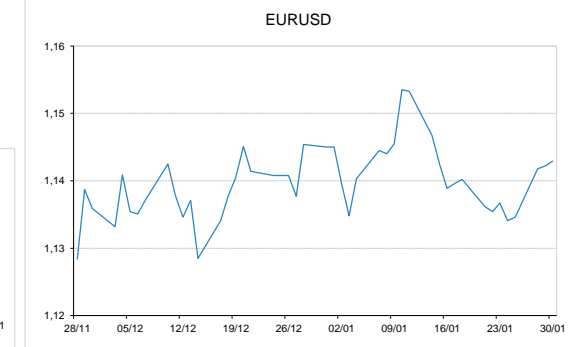
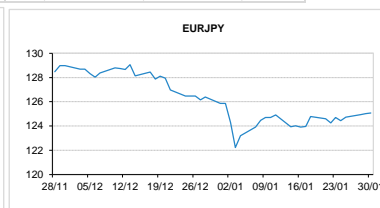
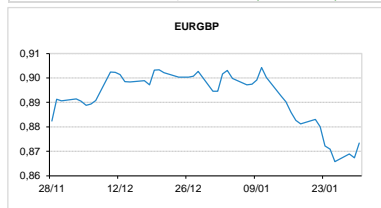
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7700	-1	1	2,6821	2,5490	2,7150
2Y	2,7340	-1	6	2,5900	2,5920	2,7540
3Y	2,6840	0	6	2,5760	2,6320	2,8234
4Y	2,6590	-1	-8	2,6150	2,6710	2,8350
5Y	2,6620	-1	3	2,6407	2,7110	2,8942
7Y	2,6970	-1	2	2,6745	2,7840	2,9190
10Y	2,7710	-1	1	2,7660	2,8570	2,9731
15Y	2,8570	-1	1	2,8410	2,8980	2,9510
20Y	2,8830	-1	1	2,8630	2,8970	2,9315
30Y	2,8790	-1	0	2,8520	2,8720	2,8900



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,48	1,16	9,27	OT 2Y	-0,183	-0,01	16,70
JETFUEL	619,50	5,75	81,50	OT 5Y	0,467	-0,01	1,00
DIESEL	583,25	6,50	85,75	OT 10Y	1,668	0,00	-5,40
COBRE	6.062,50	48,00	53,00	BUND 10Y	-0,387	-1,23	-12,40
ZINCO	2.671,00	-27,50	221,00	SCHATZ 2Y	0,057	0,69	2,90
OURO	1.311,50	1,60	32,51	T-NOTE 10Y	3,429	1,82	4,30
TRIGO	513,25	0,00	1,75	T-NOTE 2Y	2,924	1,76	11,10
LICENÇA C02	23,09	-0,30	-1,89	GILT 10Y	1,485	-1,15	-1,20


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1429	0,06%	-0,18%	1,1518	1,1608	1,1800
EUR/GBP	0,87341	-0,69%	2,42%	0,8762	0,8791	0,8856
EUR/JPY	125,08	-0,04%	0,62%	125,08	125,08	125,08
EUR/CHF	1,1404	-0,25%	-1,29%	1,1393	1,1380	1,1357
EUR/BRL	4,2482	0,19%	4,65%	4,3074	4,3714	4,5046
EUR/PLN	4,2885	0,17%	0,02%	4,3105	4,3333	4,3807

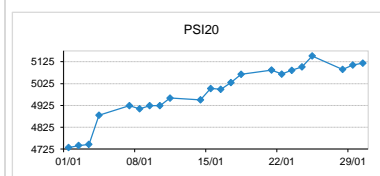

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1429	0,8734	125,08	1,1404	10,3794	7,4652	1,5058	1,58667	4,2482	9,6759
USD	0,8752	-	0,7651	109,585	0,9983	9,0845	6,5336	1,3201	1,3908	3,7187	8,4743

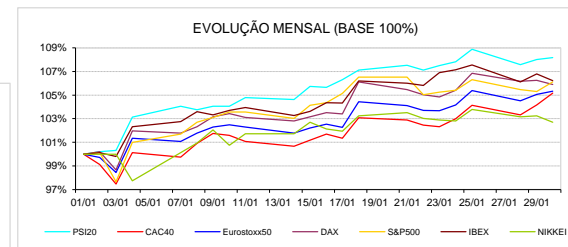
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,160	1,27	23,45
BCP	0,244	-0,04	6,27
CORT. AMORIM	9,700	-0,31	7,78
CTT	3,118	-0,38	5,84
EDP	3,155	0,61	3,48
EDP R	7,850	0,00	0,96
GALP	13,495	-0,84	-2,17
IBERSOL	8,460	-0,24	7,09
J MARTINS	12,450	-0,40	20,41
MOTA ENGIL	1,950	2,63	21,12
NAVIGATOR	4,296	2,33	19,33
NOS	5,655	0,09	6,80
NOVABASE	2,210	-0,45	9,41
PHAROL	0,183	-0,11	12,13
REN	2,616	-0,15	7,48
SEMAPA	15,000	0,94	14,50
SONAE CAP.	0,873	0,23	2,83
SONAE SGPS	0,908	-0,55	12,04

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	2,63
NAVIGATOR	2,33
ALTRI	1,27
SEMAPA	0,94
EDP	0,61
CTT	-0,38
J MARTINS	-0,40
NOVABASE	-0,45
SONAE SGPS	-0,55
GALP	-0,84



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.118,56	0,16%	8,18%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.974,76	0,95%	5,16%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.161,74	0,26%	5,34%	3.636,22	2.908,70
XTRA DAX	11.181,66	-0,33%	5,90%	13.309,86	10.279,20
S&P 500	2.660,85	0,76%	6,11%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.071,50	-0,52%	6,22%	10.543,70	8.286,20
NIKKEI 225	20.556,54	-0,52%	2,71%	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.