

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

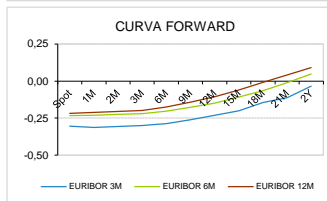
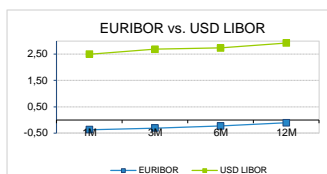
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

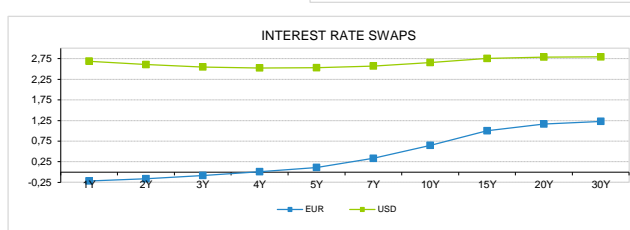
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4979	-1	-1	0,7309	-0,7786
3M	-0,3080	0	0	3M	2,6880	-1	-10	0,8750	-0,7076
6M	-0,2310	0	1	6M	2,7336	-1	-13	1,0005	-0,6518
12M	-0,1100	0	1	12M	2,9243	-1	-9	1,1376	-0,5112

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2168	0	1	-0,1075	0,3074	0,7900
2Y	-0,1610	0	-1	-0,0090	0,4305	0,9110
3Y	-0,0820	0	-3	0,0966	0,5490	1,0260
4Y	0,0100	0	-6	0,2105	0,6695	1,1285
5Y	0,1110	-1	-9	0,3255	0,7860	1,2190
7Y	0,3310	-1	-13	0,5565	0,9885	1,3625
10Y	0,6450	-1	-16	0,8515	1,2086	1,4985
15Y	1,0000	-1	-18	1,1507	1,3921	1,5765
20Y	1,1650	-1	-17	1,2756	1,4395	1,5565
30Y	1,2270	-1	-17	1,3011	1,4021	1,4705

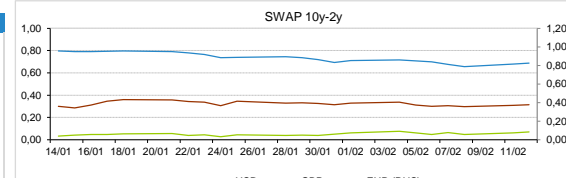
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



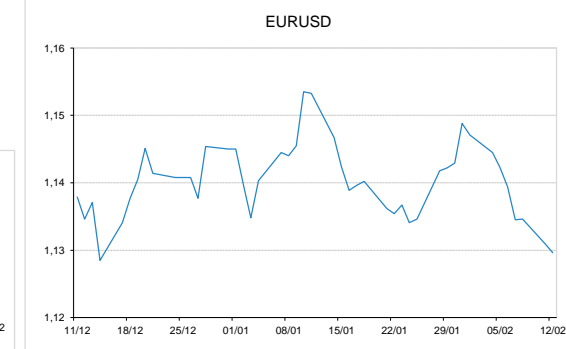
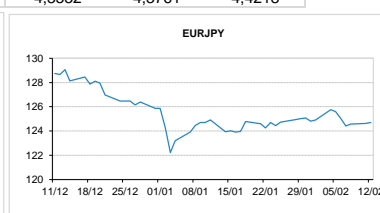
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6860	-2	-8	2,5791	2,4775	2,6790
2Y	2,6050	-2	-9	2,5312	2,5450	2,7185
3Y	2,5460	-3	-9	2,4875	2,5720	2,7560
4Y	2,5240	-3	-9	2,5250	2,6135	2,7950
5Y	2,5280	-3	-9	2,5550	2,6710	2,8551
7Y	2,5700	-3	-8	2,6210	2,7210	2,8820
10Y	2,6550	-3	-7	2,7150	2,8401	2,9160
15Y	2,7530	-3	-6	2,7805	2,8515	2,9000
20Y	2,7860	-3	-5	2,8045	2,8465	2,9070
30Y	2,7900	-3	-4	2,8453	2,8240	2,8690



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,60	1,09	1,97	OT 2Y	-0,218	-0,02	-2,90
JETFUEL	612,18	-1,70	-2,57	OT 5Y	0,402	-0,03	-6,70
DIESEL	580,68	-0,20	9,93	OT 10Y	1,638	-0,02	-6,70
COBRE	6.144,50	-60,00	208,00	BUND 10Y	-0,447	1,94	-12,10
ZINCO	2.647,50	-59,50	144,50	SCHATZ 2Y	0,053	0,92	1,40
OURO	1.310,41	2,98	20,12	T-NOTE 10Y	3,393	1,81	0,00
TRIGO	517,75	-0,50	-1,75	T-NOTE 2Y	2,865	1,36	-1,40
LICENÇA C02	20,68	-1,72	-2,06	GILT 10Y	1,418	1,24	-10,40


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1296	-0,12%	-1,49%	1,1382	1,1473	1,1657
EUR/GBP	0,87705	-0,10%	1,78%	0,8797	0,8826	0,8888
EUR/JPY	124,7	-0,06%	-0,62%	124,70	124,70	124,70
EUR/CHF	1,1392	-0,58%	-1,24%	1,1381	1,1370	1,1347
EUR/BRL	4,2013	0,80%	0,94%	4,2612	4,3264	4,4592
EUR/PLN	4,3312	-0,18%	-0,93%	4,3532	4,3761	4,4218

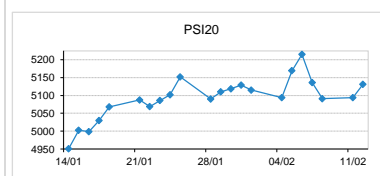

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1296	0,8771	124,70	1,1392	10,4832	7,4626	1,4991	1,5954	4,2013	9,7950
USD	0,8851	-	0,7762	110,515	1,0073	9,2874	6,6050	1,3257	1,4105	3,7289	8,6756

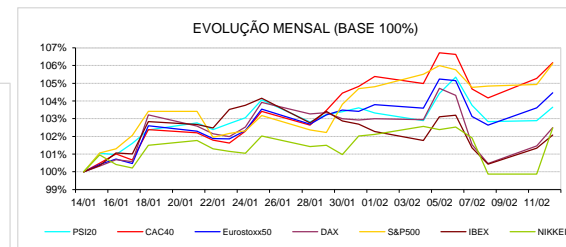
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,460	2,19	28,62
BCP	0,234	0,95	1,96
CORT. AMORIM	10,080	0,80	12,00
CTT	3,112	-0,26	5,63
EDP	3,190	1,01	4,62
EDP R	7,855	0,26	1,03
GALP	13,800	1,58	0,04
IBERSOL	7,980	-3,62	1,01
J MARTINS	12,925	-0,19	25,00
MOTA ENGIL	1,892	3,39	17,52
NAVIGATOR	4,254	1,72	18,17
NOS	5,500	0,00	3,87
NOVABASE	2,180	1,87	7,92
PHAROL	0,181	0,00	11,15
REN	2,620	0,00	7,64
SEMAPA	15,320	2,54	16,95
SONAE CAP.	0,895	-0,67	5,42
SONAE SGPS	0,911	0,11	12,41

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	3,39
SEMAPA	2,54
ALTRI	2,19
NOVABASE	1,87
NAVIGATOR	1,72
J MARTINS	-0,19
CTT	-0,26
SONAE CAP.	-0,67
IBERSOL	-3,62



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.131,51	0,74%	8,45%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.056,35	0,84%	6,88%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.191,37	0,83%	6,34%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.126,08	1,01%	5,37%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.740,34	1,13%	9,32%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.001,50	0,73%	5,41%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.864,21	2,61%	4,24%	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.