

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

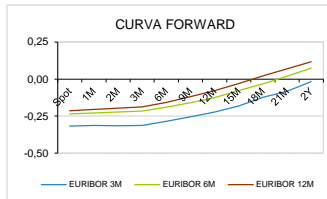
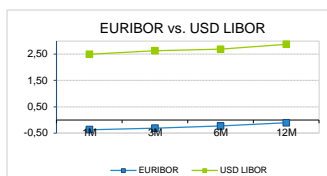
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

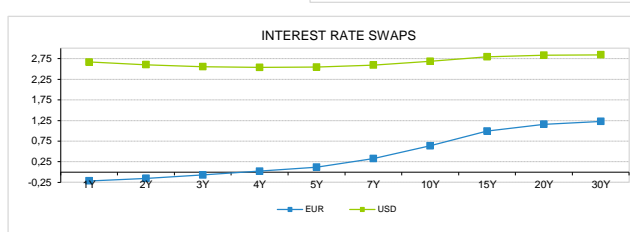
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4930	1	-1	0,7293	-0,7756
3M	-0,3100	0	0	3M	2,6289	-1	-12	0,8566	-0,7156
6M	-0,2290	0	1	6M	2,6870	-1	-15	0,9923	-0,6458
12M	-0,1080	0	1	12M	2,8783	0	-15	1,1343	-0,5130

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2132	0	1	-0,0787	0,3450	0,7940
2Y	-0,1530	0	1	0,0163	0,4580	0,9090
3Y	-0,0710	0	-1	0,1296	0,5700	1,0190
4Y	0,0210	-1	-2	0,2444	0,6830	1,1220
5Y	0,1190	-1	-4	0,3510	0,7920	1,2098
7Y	0,3290	-2	-7	0,5710	0,9940	1,3675
10Y	0,6350	-1	-9	0,8630	1,2151	1,5010
15Y	0,9920	-1	-8	1,1580	1,3968	1,5870
20Y	1,1600	-1	-7	1,2896	1,4545	1,5730
30Y	1,2290	-1	-6	1,3244	1,4250	1,4940

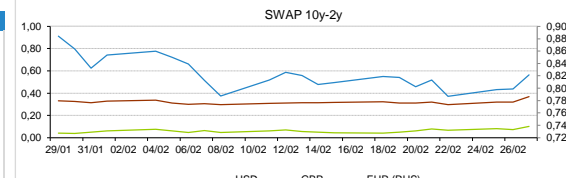
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



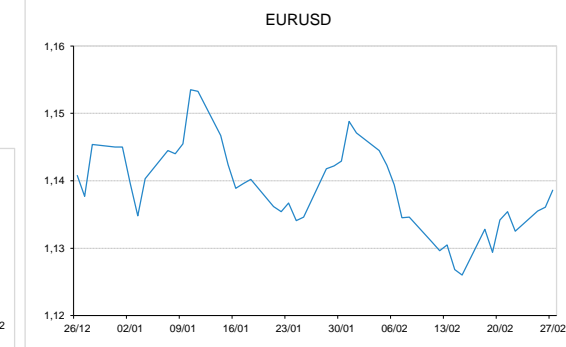
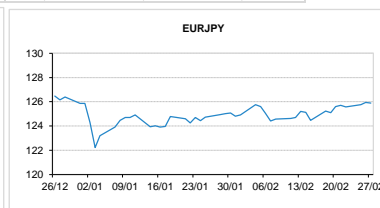
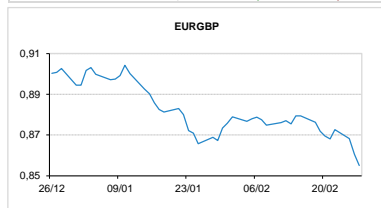
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6660	-1	-12	2,5158	2,4834	2,6881
2Y	2,6030	0	-14	2,4500	2,5359	2,7176
3Y	2,5530	0	-14	2,4100	2,5857	2,7275
4Y	2,5360	0	-13	2,4360	2,6070	2,8194
5Y	2,5440	0	-13	2,4580	2,6530	2,8578
7Y	2,5920	1	-11	2,5920	2,7595	2,8710
10Y	2,6850	1	-10	2,7229	2,8200	2,8795
15Y	2,7940	2	-8	2,7960	2,8520	2,9190
20Y	2,8340	2	-6	2,8070	2,8790	2,8890
30Y	2,8430	3	-5	2,8509	2,8846	2,8670



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	66,58	1,37	4,99	OT 2Y	-0,250	0,00	-6,90
JETFUEL	653,75	9,00	45,84	OT 5Y	0,291	0,02	-17,80
DIESEL	629,75	11,00	57,09	OT 10Y	1,451	0,02	-19,70
COBRE	6.467,50	13,00	437,00	BUND 10Y	-0,426	3,45	-6,40
ZINCO	2.761,50	21,25	71,00	SCHATZ 2Y	0,076	0,46	3,50
OURO	1.317,93	-7,83	20,21	T-NOTE 10Y	3,390	3,61	-5,10
TRIGO	468,00	-0,25	-59,00	T-NOTE 2Y	2,891	2,73	-4,10
LICENÇA C02	21,27	1,61	-2,66	GILT 10Y	1,219	7,25	-0,70


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1386	0,22%	-0,28%	1,1475	1,1564	1,1741
EUR/GBP	0,85503	0,65%	1,62%	0,8577	0,8606	0,8667
EUR/JPY	125,9	0,02%	-0,76%	125,90	125,90	125,90
EUR/CHF	1,1379	0,01%	-0,40%	1,1368	1,1357	1,1332
EUR/BRL	4,2426	0,68%	1,45%	4,3033	4,3700	4,5010
EUR/PLN	4,3166	0,24%	-0,54%	4,3379	4,3593	4,4029

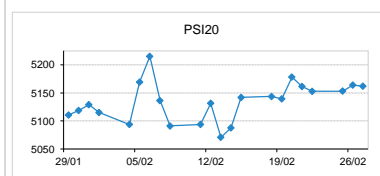

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1386	0,8550	125,90	1,1379	10,5369	7,4614	1,4943	1,59366	4,2426	9,7130
USD	0,8785	-	0,7498	110,895	0,9986	9,2505	6,5546	1,3141	1,4001	3,7356	8,5311

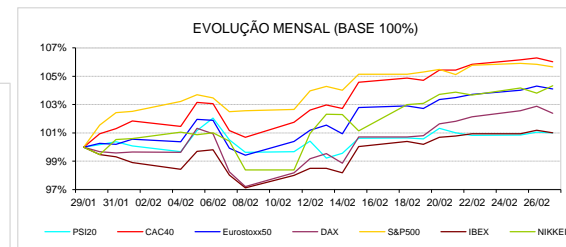
ACCIONISTA

TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,210	-0,14	24,31
BCP	0,234	0,21	2,05
CORT. AMORIM	9,690	2,43	7,67
CTT	2,784	0,07	-5,50
EDP	3,192	0,63	4,69
EDP R	8,265	-0,12	6,30
GALP	14,585	-1,05	5,73
IBERSOL	8,060	1,51	2,03
J MARTINS	13,200	0,76	27,66
MOTA ENGIL	2,045	0,74	27,02
NAVIGATOR	4,360	-0,91	21,11
NOS	5,235	-1,41	-1,13
NOVABASE	2,440	-0,81	20,79
PHAROL	0,189	1,72	15,81
REN	2,604	0,15	6,98
SEMAPA	15,440	0,39	17,86
SONAE CAP.	0,865	-0,57	1,88
SONAE SGPS	0,926	0,16	14,32

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	2,43
PHAROL	1,72
IBERSOL	1,51
J MARTINS	0,76
MOTA ENGIL	0,74
SONAE CAP.	-0,57
NOVABASE	-0,81
NAVIGATOR	-0,91
GALP	-1,05
NOS	-1,41



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.162,05	-0,04%	9,10%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.225,35	-0,26%	10,46%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.282,77	-0,20%	9,37%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.487,33	-0,46%	8,79%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.789,28	-0,17%	11,26%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.211,70	-0,17%	7,87%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.556,51	0,50%	7,70%	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.