

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

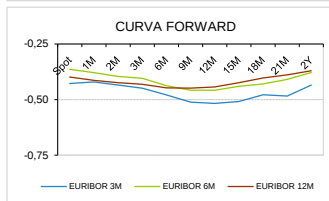
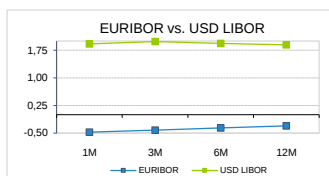
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

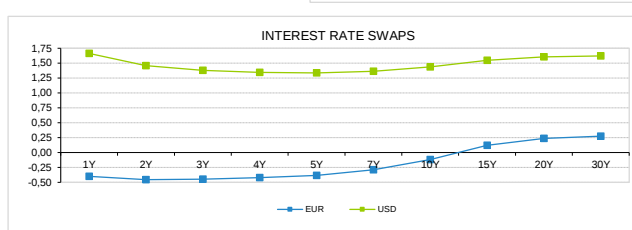
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4730	-1	-2	1M	1,9213	-1	-12	0,7103	-0,8034
3M	-0,4180	0	1	3M	1,9861	0	-15	0,7738	-0,7900
6M	-0,3580	2	5	6M	1,9355	-1	-10	0,8290	-0,7286
12M	-0,3030	2	7	12M	1,8960	1	-7	0,8854	-0,6220

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3983	1	7	-0,4411	-0,2760	-0,0134
2Y	-0,4550	2	6	-0,4075	-0,2160	0,0640
3Y	-0,4480	3	7	-0,3634	-0,1480	0,1410
4Y	-0,4210	3	8	-0,3120	-0,0750	0,2160
5Y	-0,3850	3	8	-0,2520	-0,0010	0,2830
7Y	-0,2900	3	6	-0,1167	0,1406	0,3934
10Y	-0,1180	3	4	0,0799	0,3047	0,5123
15Y	0,1210	3	2	0,3042	0,4584	0,5896
20Y	0,2380	3	1	0,4050	0,5038	0,5827
30Y	0,2750	2	-1	0,4199	0,4687	0,5026

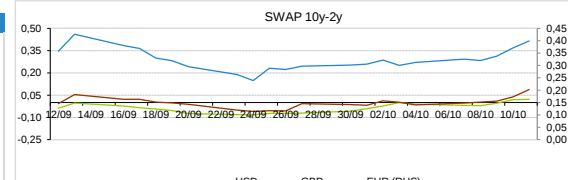
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



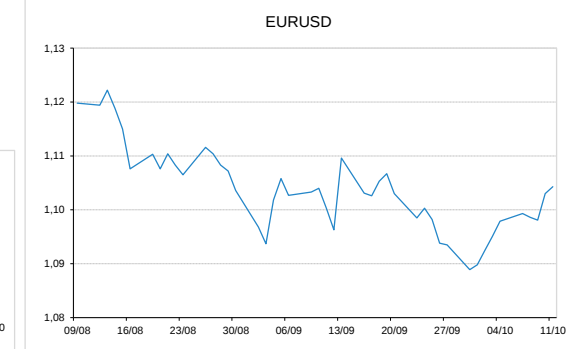
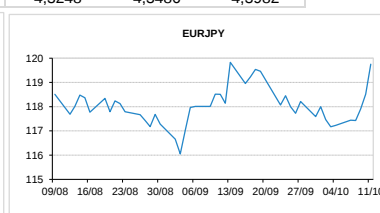
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,6630	1	-13	1,5093	1,4850	1,6512
2Y	1,4570	-1	-7	1,4485	1,5206	1,6285
3Y	1,3790	-1	-4	1,4884	1,5470	1,7257
4Y	1,3450	-1	-3	1,4970	1,5630	1,7420
5Y	1,3360	-1	-3	1,4210	1,6220	1,7988
7Y	1,3620	-1	-2	1,5790	1,6980	1,7805
10Y	1,4360	-1	-1	1,6911	1,6835	1,7825
15Y	1,5480	-8	9	1,6855	1,8390	1,8295
20Y	1,6040	-7	9	1,8296	1,8480	1,8335
30Y	1,6210	-1	0	1,8477	1,8754	1,8890



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	60,35	1,25	0,41	OT 2Y	-0,584	0,00	3,50
JETFUEL	618,25	-6,32	-14,83	OT 5Y	-0,223	0,00	2,30
DIESEL	586,25	-6,32	-14,33	OT 10Y	0,201	0,00	-6,50
COBRE	5.780,50	97,00	-44,00	BUND 10Y	-0,879	5,20	13,90
ZINCO	2.428,25	100,25	85,25	SCHATZ 2Y	-0,098	0,69	11,90
OURO	1.480,88	-14,48	-12,88	T-NOTE 10Y	2,588	7,90	0,10
TRIGO	509,00	16,00	31,50	T-NOTE 2Y	2,049	8,21	-0,80
LICENÇA C02	24,31	1,05	-1,96	GILT 10Y	0,707	16,53	6,70


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1043	0,12%	0,36%	1,1117	1,1181	1,1310
EUR/GBP	0,87518	3,01%	1,85%	0,8781	0,8811	0,8872
EUR/JPY	119,75	-1,03%	-1,04%	119,75	119,75	119,75
EUR/CHF	1,1007	-0,35%	-0,68%	1,0996	1,0985	1,0969
EUR/BRL	4,5271	-0,15%	-1,06%	4,5753	4,6182	4,7280
EUR/PLN	4,3002	0,31%	0,97%	4,3248	4,3486	4,3982

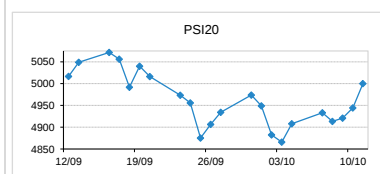

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1043	0,8752	119,75	1,1007	10,8213	7,4691	1,4561	1,62244	4,5271	10,0092
USD	0,9064	-	0,7886	108,595	0,9984	9,8176	6,7700	1,3198	1,4722	4,1102	9,0769

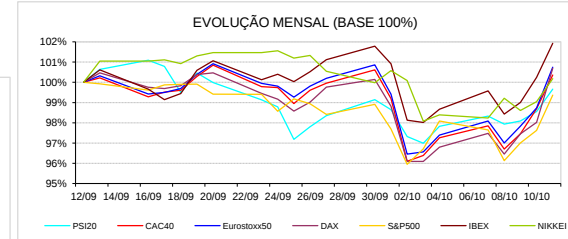
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,475	3,11	-5,60
BCP	0,196	2,56	-14,60
CORT. AMORIM	9,760	0,83	8,44
CTT	2,210	1,47	-24,98
EDP	3,586	-0,25	17,61
EDP R	9,850	1,13	26,69
GALP	13,660	1,49	-0,98
IBERSOL	8,040	2,03	1,77
J MARTINS	15,165	0,66	46,66
MOTA ENGIL	1,891	3,62	17,45
NAVIGATOR	3,310	5,35	-8,06
NOS	5,210	0,68	-1,61
NOVABASE	2,570	0,39	27,23
PHAROL	0,105	0,77	-35,91
RAMADA	6,100	0,66	-18,67
REN	12,320	4,05	-5,95
SEMAPA	0,617	0,65	-27,33
SONAE CAP.	0,879	-1,24	8,52
SONAE SGPS	6,100	0,66	-18,67

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NAVIGATOR	5,35
REN	4,05
MOTA ENGIL	3,62
ALTRI	3,11
BCP	2,56
EDP	-0,25
SONAE CAP.	-1,24



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.999,95	1,12%	5,67%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.663,03	1,69%	19,71%	5.704,93	4.555,99
ESTX 50 PR	3.565,34	2,04%	18,79%	3.588,68	2.908,70
XTRA DAX	12.496,28	2,73%	18,35%	12.656,05	10.279,20
S&P 500	2.991,38	1,78%	19,30%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	9.257,40	1,68%	8,40%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	21.798,87	1,15%	8,91%	23.051,19	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.