

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

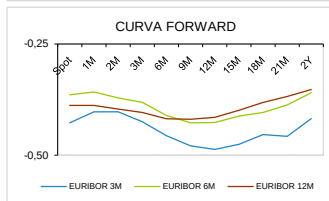
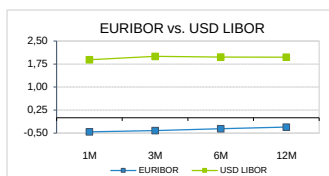
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

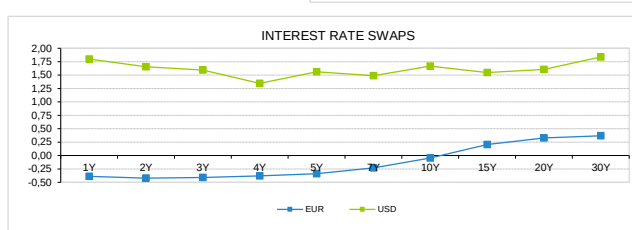
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4580	1	-2	1M	1,8908	-2	-13	0,7144	-0,7952
3M	-0,4180	0	-2	3M	2,0009	0	-14	0,7825	-0,7800
6M	-0,3580	-1	2	6M	1,9780	0	-9	0,8584	-0,7144
12M	-0,3030	0	2	12M	1,9731	2	-8	0,9571	-0,5938

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3874	0	1	-0,4170	-0,2561	-0,0134
2Y	-0,4220	1	1	-0,3834	-0,1980	0,0660
3Y	-0,4100	1	10	-0,3420	-0,1354	0,1443
4Y	-0,3790	1	12	-0,2902	-0,0651	0,2174
5Y	-0,3390	1	3	-0,2345	0,0079	0,2850
7Y	-0,2320	2	12	-0,1033	0,1465	0,3953
10Y	-0,0450	3	1	0,0899	0,3109	0,5169
15Y	0,2040	4	10	0,3111	0,4611	0,5964
20Y	0,3290	5	10	0,4148	0,5125	0,5915
30Y	0,3680	5	9	0,4316	0,4795	0,5132

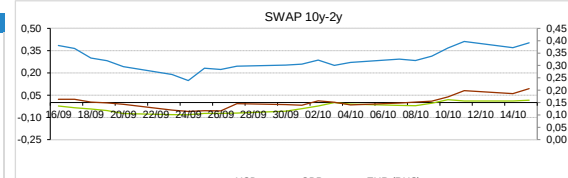
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



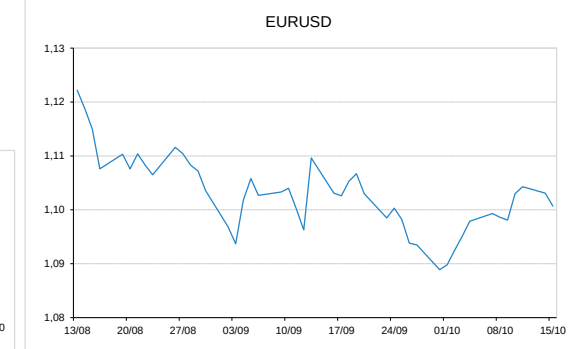
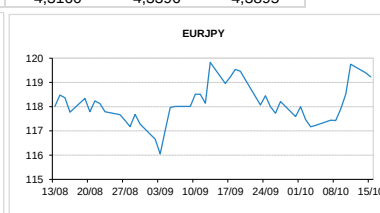
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7990	8	-6	1,5118	1,4940	1,6100
2Y	1,6560	10	1	1,4955	1,5120	1,6485
3Y	1,5930	10	3	1,4860	1,5460	1,7041
4Y	1,3450	-1	-3	1,4980	1,5800	1,7205
5Y	1,5620	11	5	1,5347	1,6150	1,7789
7Y	1,4880	13	3	1,5896	1,7005	1,8261
10Y	1,6660	10	6	1,6665	1,7757	1,8545
15Y	1,5480	-8	9	1,7737	1,8435	1,8960
20Y	1,6040	-7	9	1,8223	1,8708	1,8990
30Y	1,8370	8	5	1,8265	1,8550	1,8790



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	59,40	0,05	0,15	OT 2Y	-0,582	0,00	-6,00
JETFUEL	623,76	5,44	9,01	OT 5Y	-0,235	0,00	-7,70
DIESEL	590,50	4,92	8,17	OT 10Y	0,178	0,00	-14,30
COBRE	5.820,00	22,00	-156,50	BUND 10Y	-0,866	3,71	2,70
ZINCO	2.447,00	-2,50	59,00	SCHATZ 2Y	-0,066	1,60	2,80
OURO	1.482,73	-10,63	-7,57	T-NOTE 10Y	2,584	2,74	-13,30
TRIGO	508,00	-3,00	24,50	T-NOTE 2Y	2,051	1,72	-14,80
LICENÇA C02	25,71	1,56	-0,67	GILT 10Y	0,680	4,41	-7,80


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1007	-0,22%	-0,22%	1,1079	1,1142	1,1270
EUR/GBP	0,87058	1,06%	1,67%	0,8735	0,8764	0,8824
EUR/JPY	119,23	0,14%	-0,23%	119,23	119,23	119,23
EUR/CHF	1,1015	-0,16%	-0,88%	1,1003	1,0993	1,0975
EUR/BRL	4,5804	-0,66%	-2,01%	4,6282	4,6702	4,7814
EUR/PLN	4,2918	0,05%	0,84%	4,3160	4,3396	4,3895

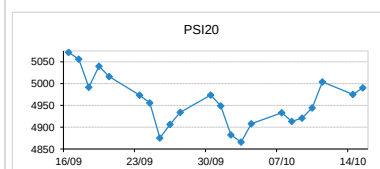

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1007	0,8706	119,23	1,1015	10,7995	7,4706	1,4572	1,6333	4,5804	10,0587
USD	0,9060	-	0,7826	108,755	0,9986	9,7977	6,7685	1,3209	1,4783	4,1447	9,1309

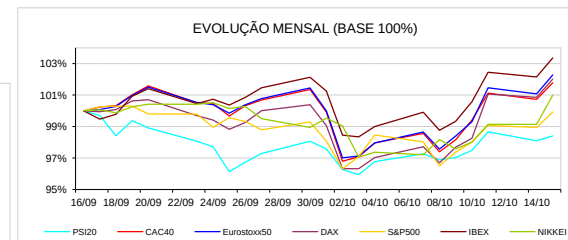
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,390	0,47	-7,07
BCP	0,196	1,98	-14,51
CORT. AMORIM	9,640	-1,03	7,11
CTT	2,210	0,18	-24,98
EDP	3,587	0,22	17,65
EDP R	9,810	-0,41	26,17
GALP	13,650	0,63	-1,05
IBERSOL	7,580	-3,81	-4,05
J MARTINS	15,025	0,30	45,31
MOTA ENGIL	1,920	2,18	19,25
NAVIGATOR	3,280	0,74	-8,89
NOS	5,205	-1,05	-1,70
NOVABASE	2,440	-2,01	20,79
PHAROL	0,102	-0,58	-37,25
RAMADA	6,100	-1,29	-18,67
REN	12,400	0,49	-5,34
SEMAPA	0,660	0,00	-22,26
SONAE CAP.	0,902	1,52	11,30
SONAE SGPS	6,100	-1,29	-18,67

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	2,18
BCP	1,98
SONAE CAP.	1,52
NAVIGATOR	0,74
GALP	0,63
NOS	-1,05
RAMADA	-1,29
NOVABASE	-2,01
IBERSOL	-3,81



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.990,44	0,31%	5,47%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.702,05	1,04%	20,53%	5.724,31	4.555,99
ESTX 50 PR	3.598,67	1,19%	19,90%	3.610,31	2.908,70
XTRA DAX	12.629,79	1,15%	19,61%	12.682,40	10.279,20
S&P 500	2.995,63	0,99%	19,50%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	9.356,10	1,19%	9,56%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	22.207,21	1,87%	10,95%	22.959,41	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.