

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

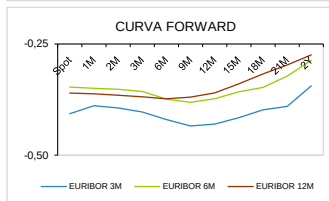
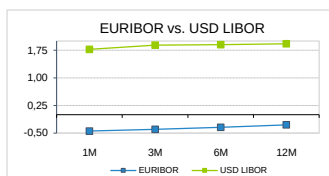
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

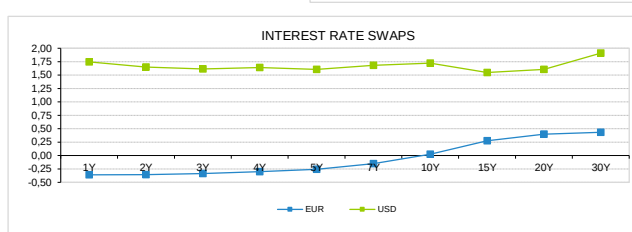
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4430	0	3	1M	1,7743	-1	-24	0,7135	-0,7626
3M	-0,3980	0	3	3M	1,8905	-1	-20	0,8154	-0,7242
6M	-0,3430	1	5	6M	1,9024	-1	-15	0,8871	-0,6574
12M	-0,2760	1	6	12M	1,9253	-3	-11	0,9831	-0,5338

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3601	0	8	-0,3599	-0,1734	0,1061
2Y	-0,3570	1	9	-0,3173	-0,1052	0,1804
3Y	-0,3350	1	11	-0,2695	-0,0347	0,2564
4Y	-0,3000	1	12	-0,2113	0,0381	0,3269
5Y	-0,2580	1	12	-0,1478	0,1116	0,3924
7Y	-0,1530	0	13	-0,0109	0,2499	0,5092
10Y	0,0250	0	13	0,1865	0,4186	0,6371
15Y	0,2740	0	14	0,4164	0,5760	0,7210
20Y	0,3970	-1	14	0,5245	0,6283	0,7149
30Y	0,4330	-1	14	0,5394	0,5912	0,6278

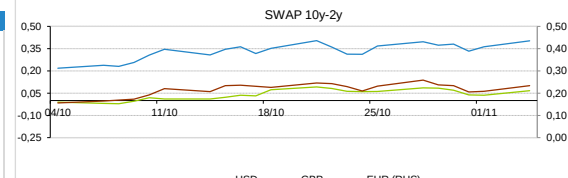
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,00
Austrália	0,75
Índia	4,00



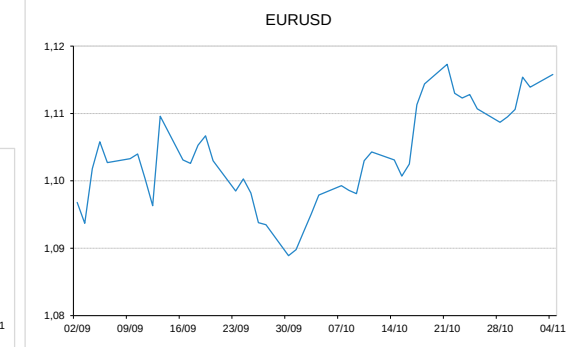
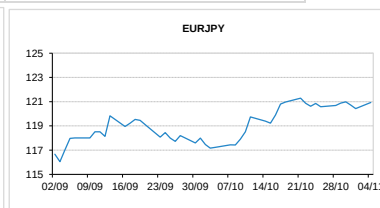
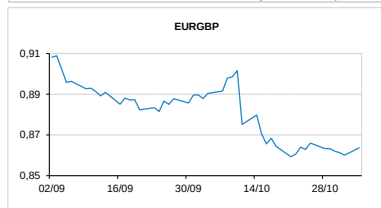
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7460	-4	-9	1,5193	1,5075	1,6580
2Y	1,6500	-3	1	1,5038	1,5360	1,5890
3Y	1,6150	-4	5	1,5204	1,5735	1,7505
4Y	1,6390	10	10	1,5030	1,6160	1,6979
5Y	1,6050	-4	9	1,5445	1,6630	1,8420
7Y	1,6820	8	19	1,5980	1,7295	1,8650
10Y	1,7230	-5	14	1,7318	1,8375	1,9170
15Y	1,5480	-8	9	1,8150	1,8920	1,9836
20Y	1,6040	-7	9	1,8670	1,9365	1,9670
30Y	1,9090	-5	17	1,8880	1,9293	1,9400



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,66	0,97	4,92	OT 2Y	-0,537	0,01	8,00
JETFUEL	612,25	-6,50	-5,65	OT 5Y	-0,184	0,01	7,20
DIESEL	578,00	-1,33	-3,40	OT 10Y	0,234	0,03	8,80
COBRE	5.862,00	53,00	164,00	BUND 10Y	-0,793	2,97	23,80
ZINCO	2.580,00	55,00	256,50	SCHATZ 2Y	-0,023	0,23	13,70
OURO	1.507,88	-1,35	-0,59	T-NOTE 10Y	2,620	4,43	21,20
TRIGO	511,25	-4,75	20,75	T-NOTE 2Y	2,072	3,25	25,50
LICENÇA C02	25,64	0,35	2,70	GILT 10Y	0,705	4,77	23,30


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1158	0,17%	1,63%	1,1228	1,1290	1,1413
EUR/GBP	0,86368	-0,42%	3,10%	0,8666	0,8694	0,8754
EUR/JPY	120,93	-0,41%	-3,06%	120,93	120,93	120,93
EUR/CHF	1,0998	0,07%	-0,64%	1,0989	1,0981	1,0965
EUR/BRL	4,4569	-0,01%	-0,04%	4,5043	4,5450	4,6521
EUR/PLN	4,2670	-0,32%	1,26%	4,2914	4,3146	4,3627

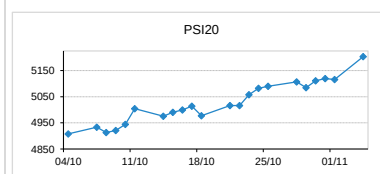

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1158	0,8637	120,93	1,0998	10,7060	7,4711	1,4648	1,6155	4,4569	10,1655
USD	0,8965	-	0,7741	108,505	0,9865	9,5899	6,6979	1,3141	1,4489	3,9916	9,1178

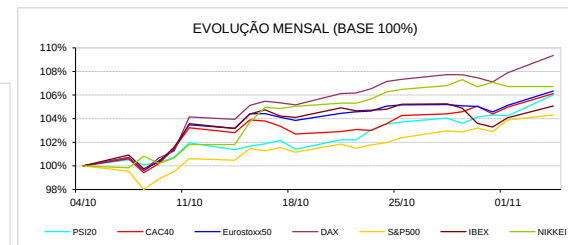
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,895	6,22	1,64
BCP	0,208	2,51	-9,28
CORT. AMORIM	10,000	3,95	11,11
CTT	2,806	0,50	-4,75
EDP	3,709	0,27	21,65
EDP R	10,220	1,39	31,45
GALP	14,625	2,24	6,02
IBERSOL	7,500	0,27	-5,06
J MARTINS	15,130	0,87	46,32
MOTA ENGIL	2,084	3,48	29,44
NAVIGATOR	3,444	5,06	-4,33
NOS	5,330	1,23	0,66
NOVABASE	2,510	0,80	24,26
PHAROL	0,097	2,42	-40,44
RAMADA	6,380	0,63	-14,93
REN	12,700	0,00	-3,05
SEMAPA	0,714	0,71	-15,90
SONAE CAP.	0,916	1,38	13,09
SONAE SGPS	6,380	0,63	-14,93

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	6,22
NAVIGATOR	5,06
CORT. AMORIM	3,95
MOTA ENGIL	3,48
BCP	2,51



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.203,39	1,71%	9,97%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.824,30	1,08%	23,12%	5.833,69	4.555,99
ESTX 50 PR	3.665,21	1,14%	22,12%	3.671,81	2.908,70
XTRA DAX	13.136,28	1,35%	24,41%	13.171,17	10.279,20
S&P 500	3.079,61	0,41%	22,85%	3.085,20	2.346,58
IBEX 35	9.416,40	0,95%	10,26%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	22.850,77	-0,33%	14,17%	23.008,43	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.