

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

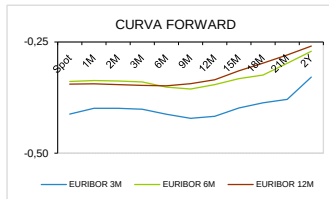
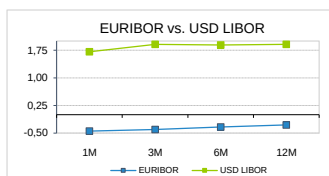
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

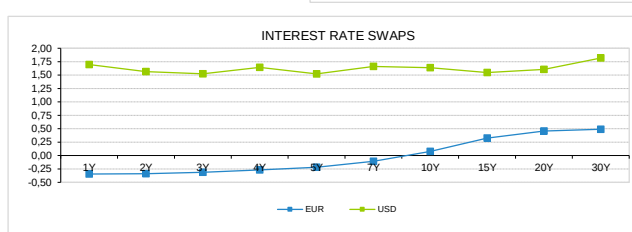
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4450	1	0	1M	1,7080	-1	-12	0,7171	-0,7554
3M	-0,4030	1	0	3M	1,9095	1	-2	0,7978	-0,7160
6M	-0,3350	1	1	6M	1,8935	0	-4	0,8614	-0,6466
12M	-0,2770	0	1	12M	1,9086	0	-5	0,9655	-0,5196

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3450	0	2	-0,3349	-0,1574	0,0707
2Y	-0,3390	0	3	-0,2969	-0,1040	0,1383
3Y	-0,3120	1	3	-0,2527	-0,0452	0,2096
4Y	-0,2690	2	3	-0,2013	0,0177	0,2761
5Y	-0,2190	2	3	-0,1469	0,0847	0,3390
7Y	-0,1070	3	3	-0,0251	0,2114	0,4456
10Y	0,0760	4	1	0,1554	0,3700	0,5680
15Y	0,3250	4	0	0,3731	0,5210	0,6520
20Y	0,4550	4	0	0,4760	0,5710	0,6442
30Y	0,4900	4	-1	0,4821	0,5272	0,5565

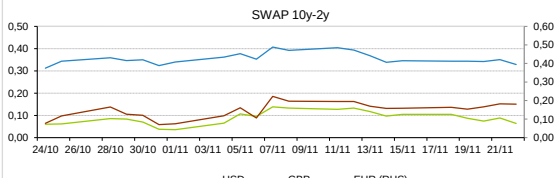
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,00
Austrália	0,75
Índia	4,00



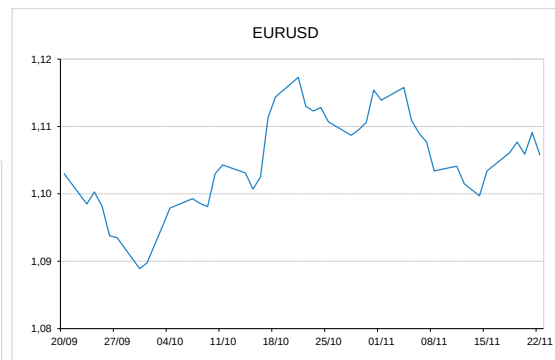
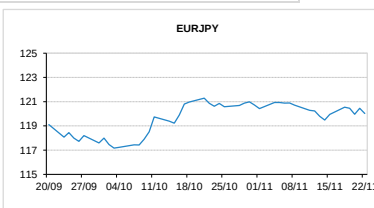
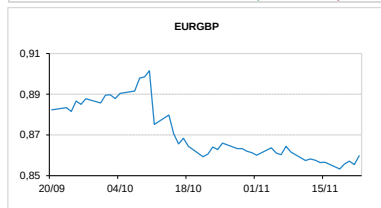
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,6960	-3	-5	1,4476	1,4765	1,6170
2Y	1,5640	-4	-5	1,4285	1,5230	1,6320
3Y	1,5230	-4	-4	1,4435	1,5667	1,6685
4Y	1,6430	6	11	1,4700	1,5660	1,7180
5Y	1,5220	-5	-3	1,4930	1,6345	1,7764
7Y	1,6610	-3	31	1,5515	1,7053	1,7970
10Y	1,6370	-6	-3	1,6610	1,7814	1,8455
15Y	1,5480	-8	9	1,7545	1,8500	1,8860
20Y	1,6040	-7	9	1,8242	1,8770	1,8870
30Y	1,8180	-7	-4	1,8120	1,8360	1,8720



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	63,31	-0,66	3,87	OT 2Y	-0,475	-0,01	6,90
JETFUEL	619,19	6,21	-4,80	OT 5Y	-0,093	-0,04	11,60
DIESEL	583,25	4,50	-4,75	OT 10Y	0,400	-0,02	20,30
COBRE	5.818,00	-46,00	1,00	BUND 10Y	-0,808	-3,19	3,20
ZINCO	2.315,00	-20,50	-176,50	SCHATZ 2Y	0,000	-0,69	3,40
OURO	1.464,56	-0,84	-19,68	T-NOTE 10Y	2,626	-0,15	3,50
TRIGO	519,00	7,00	-5,25	T-NOTE 2Y	2,093	1,15	6,10
LICENÇA C02	24,58	0,64	-1,08	GILT 10Y	0,680	-5,32	1,20


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1058	-0,30%	-0,65%	1,1127	1,1188	1,1309
EUR/GBP	0,8598	-0,50%	0,10%	0,8626	0,8652	0,8706
EUR/JPY	120,03	0,36%	0,70%	120,03	120,03	120,03
EUR/CHF	1,0990	-0,07%	0,25%	1,0981	1,0971	1,0954
EUR/BRL	4,6147	0,54%	-1,50%	4,6602	4,7010	4,8176
EUR/PLN	4,2977	0,03%	-0,67%	4,3240	4,3482	4,3970

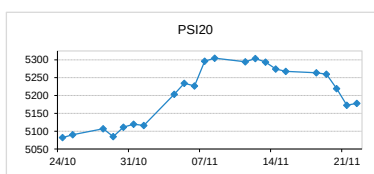

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1058	0,8598	120,03	1,0990	10,6149	7,4727	1,4662	1,62569	4,6147	10,1034
USD	0,9063	-	0,7792	108,645	0,9958	9,6170	6,7727	1,3289	1,4741	4,1825	9,1591

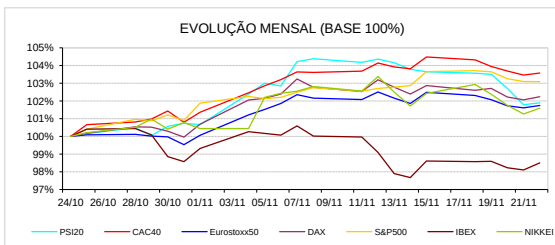
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,785	0,00	-0,26
BCP	0,204	0,44	-11,33
CORT. AMORIM	10,420	-1,88	15,78
CTT	3,096	3,20	5,09
EDP	3,632	-0,38	19,12
EDP R	9,930	-0,70	27,72
GALP	15,235	0,99	10,44
IBERSOL	7,400	0,82	-6,33
J MARTINS	14,635	0,38	41,54
MOTA ENGL	2,038	-0,39	26,58
NAVIGATOR	3,520	0,40	-2,22
NOS	5,010	-0,69	-5,38
NOVABASE	2,770	0,73	37,13
PHAROL	0,111	-2,12	-31,99
RAMADA	6,020	0,00	-19,73
REN	13,860	-0,14	5,80
SEMAPA	0,809	0,25	-4,71
SONAE CAP.	0,915	0,38	12,90
SONAE SGPS	6,020	0,00	-19,73

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	3,20
GALP	0,99
IBERSOL	0,82
NOVABASE	0,73
BCP	0,44
MOTA ENGL	-0,39
NOS	-0,69
EDP R	-0,70
CORT. AMORIM	-1,88
PHAROL	-2,12



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.178,27	0,11%	9,44%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.887,57	0,11%	24,45%	5.966,79	4.555,99
ESTX 50 PR	3.684,61	0,13%	22,76%	3.733,45	2.908,70
XTRA DAX	13.160,29	0,17%	24,64%	13.374,27	10.279,20
S&P 500	3.103,03	-0,01%	23,79%	3.127,64	2.346,58
IBEX 35	9.250,90	0,40%	8,33%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	23.112,88	0,32%	15,48%	23.591,09	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.