

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

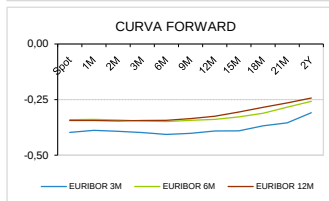
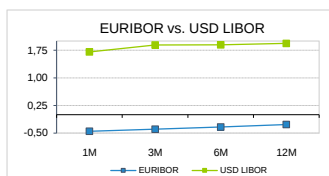
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

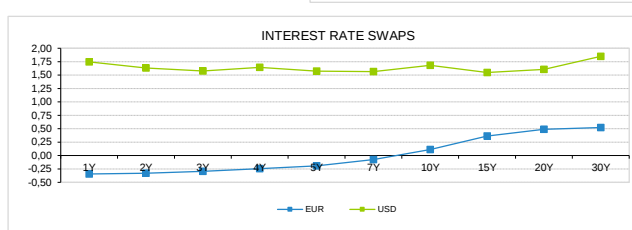
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,4500	0	-1	1M	1,7036	1	-7	0,7038
3M	-0,3930	0	1	3M	1,8915	-1	0	0,7844
6M	-0,3350	0	1	6M	1,8954	-1	-1	0,8575
12M	-0,2670	0	1	12M	1,9366	-3	1	0,9574

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3440	0	2	-0,3260	-0,1240	0,1211
2Y	-0,3290	-1	3	-0,2838	-0,0648	0,1902
3Y	-0,2940	-1	4	-0,2300	-0,0024	0,2636
4Y	-0,2460	-1	5	-0,1739	0,0637	0,3323
5Y	-0,1920	-1	7	-0,1145	0,1322	0,4010
7Y	-0,0750	0	8	0,0140	0,2633	0,5042
10Y	0,1110	0	9	0,2013	0,4233	0,6240
15Y	0,3620	1	9	0,4213	0,5749	0,7067
20Y	0,4880	1	9	0,5259	0,6246	0,6991
30Y	0,5220	1	9	0,5323	0,5808	0,6125

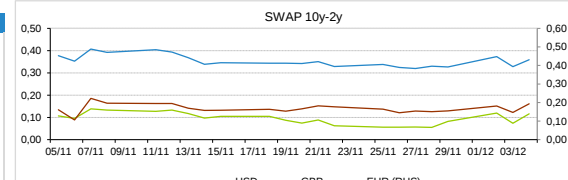
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,00
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7460	2	0	1,4777	1,5420	1,6890
2Y	1,6310	1	-2	1,4780	1,5850	1,7442
3Y	1,5760	4	-1	1,5144	1,6160	1,7849
4Y	1,6430	6	11	1,5290	1,6520	1,8239
5Y	1,5720	4	0	1,5600	1,7096	1,8640
7Y	1,5650	-2	-4	1,6443	1,7844	1,8930
10Y	1,6800	4	-1	1,7461	1,8591	1,9593
15Y	1,5480	-8	9	1,8467	1,9262	1,9780
20Y	1,6040	-7	9	1,8934	1,9513	1,9983
30Y	1,8490	3	-3	1,9101	1,9412	1,9629

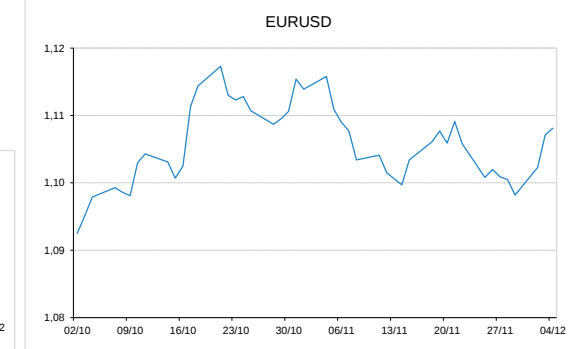
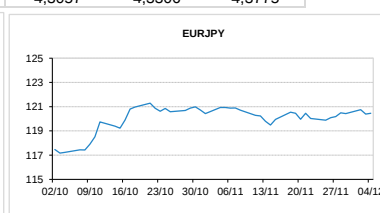


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	63,25	2,43	1,90	OT 2Y	-0,573	-0,02	-3,60
JETFUEL	606,75	-1,22	-21,42	OT 5Y	-0,123	0,01	6,10
DIESEL	586,29	12,25	-5,36	OT 10Y	0,379	0,01	14,50
COBRE	5,815,00	-68,00	-35,00	BUND 10Y	-0,765	3,12	2,80
ZINCO	2,216,00	-47,25	-342,00	SCHATZ 2Y	0,005	0,00	4,20
OURO	1,473,77	-5,22	-35,98	T-NOTE 10Y	2,634	5,96	1,80
TRIGO	526,50	1,25	10,25	T-NOTE 2Y	1,998	5,15	1,20
LICENÇA C02	24,74	0,74	-0,89	GILT 10Y	0,661	5,98	4,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1081	0,09%	-0,69%	1,1148	1,1212	1,1331
EUR/GBP	0,8461	0,70%	2,08%	0,8488	0,8516	0,8572
EUR/JPY	120,45	-0,05%	0,40%	120,45	120,45	120,45
EUR/CHF	1,0958	-0,20%	0,32%	1,0950	1,0940	1,0923
EUR/BRL	4,6396	0,43%	-3,61%	4,6836	4,7264	4,8291
EUR/PLN	4,2800	0,04%	-0,31%	4,3057	4,3306	4,3775



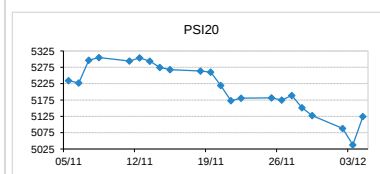
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1081	0,8461	120,45	1,0958	10,5428	7,4713	1,4634	1,61681	4,6396	10,1610
USD	0,9020	-	0,763	108,815	0,9888	9,5062	6,7389	1,3235	1,4600	4,1917	9,1621

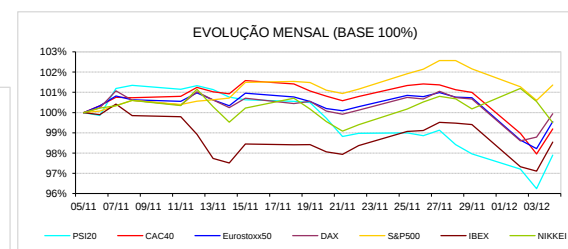
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,650	3,29	-2,59
BCP	0,194	2,92	-15,42
CORT. AMORIM	11,040	1,28	22,67
CTT	3,216	2,42	9,16
EDP	3,616	1,83	18,60
EDP R	10,060	1,31	29,39
GALP	14,465	0,35	4,86
IBERSOL	7,620	1,33	-3,54
J MARTINS	14,535	1,43	40,57
MOTA ENGIL	1,810	-0,33	12,42
NAVIGATOR	3,542	2,43	-1,61
NOS	5,035	2,17	-4,91
NOVABASE	2,780	0,00	44,63
PHAROL	0,103	2,80	-37,01
RAMADA	5,940	-1,00	-20,80
REN	13,640	1,34	4,12
SEMAPA	0,773	-0,90	-8,95
SONAE CAP.	0,941	3,29	16,11
SONAE SGPS	5,940	-1,00	-20,80

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE CAP.	3,29
ALTRI	3,29
BCP	2,92
PHAROL	2,80
NAVIGATOR	2,43
MOTA ENGIL	-0,33
SEMAPA	-0,90
RAMADA	-1,00
RAMADA	-1,00



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5,124,40	1,72%	8,30%	5,429,32	4,551,84
CAC40	5,799,68	1,27%	22,60%	5,966,79	4,555,99
ESTX 50 PR	3,660,02	1,36%	21,94%	3,733,45	2,908,70
XTRA DAX	13,140,57	1,16%	24,45%	13,374,27	10,279,20
S&P 500	3,116,56	0,75%	24,32%	3,154,26	2,346,58
IBEX 35	9,270,80	1,48%	8,56%	9,587,60	8,286,20
NIKKEI 225	23,135,23	-1,05%	15,59%	23,608,06	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.