

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

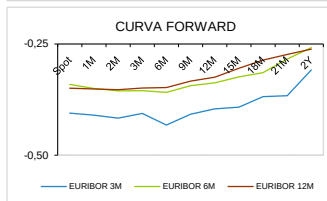
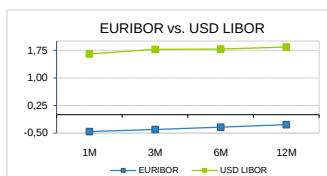
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

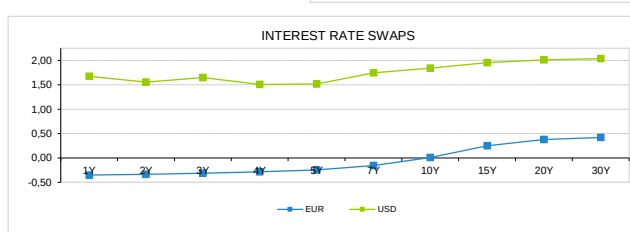
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4570	0	-1	1M	1,6493	-1	-15	0,6175	-0,7606
3M	-0,4010	0	-1	3M	1,7745	-2	-17	0,6918	-0,6700
6M	-0,3370	0	-1	6M	1,7835	-2	-14	0,7405	-0,6282
12M	-0,2700	-1	-2	12M	1,8373	-4	-17	0,7881	-0,4984

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3500	0	-3	-0,3261	-0,1755	0,0240
2Y	-0,3340	-2	-3	-0,2958	-0,1275	0,0890
3Y	-0,3120	-3	-5	-0,2554	-0,0760	0,1570
4Y	-0,2840	-4	-8	-0,2119	-0,0190	0,2240
5Y	-0,2470	-4	-10	-0,1630	0,0440	0,2850
7Y	-0,1550	-5	-13	-0,0520	0,1670	0,3939
10Y	0,0080	-6	-15	0,1208	0,3270	0,5190
15Y	0,2490	-7	-17	0,3428	0,4906	0,6140
20Y	0,3800	-7	-17	0,4475	0,5416	0,6160
30Y	0,4200	-7	-16	0,4611	0,5038	0,5340

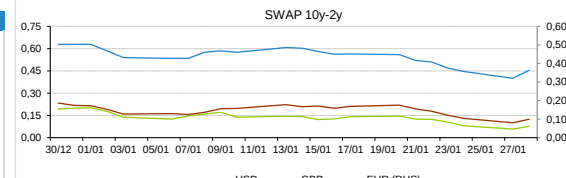
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,6750	0	-10	1,3949	1,4332	1,5755
2Y	1,5560	-1	-16	1,2955	1,4565	1,6120
3Y	1,6480	7	4	1,3115	1,4960	1,5700
4Y	1,5070	-2	-14	1,3400	1,4545	1,7039
5Y	1,5180	-3	-17	1,3580	1,5285	1,7377
7Y	1,7440	9	7	1,4325	1,6410	1,7220
10Y	1,8400	9	9	1,6095	1,6460	1,7465
15Y	1,9530	9	9	1,6320	1,7350	1,7895
20Y	2,0120	11	12	1,6895	1,7600	1,8630
30Y	2,0370	10	11	1,7895	1,7460	1,7755

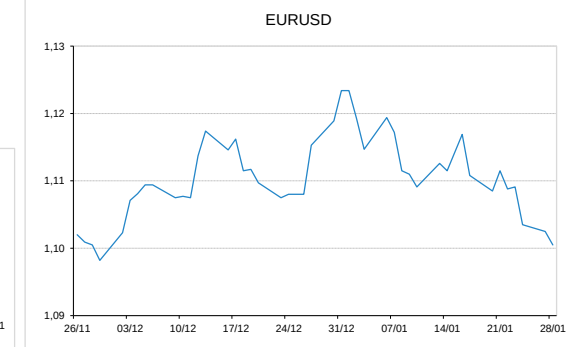
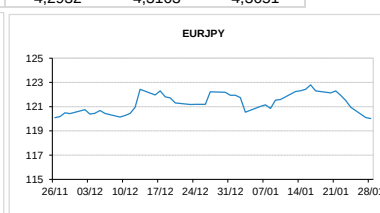


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	59,92	0,60	-6,95	OT 2Y	-0,417	0,02	12,90
JETFUEL	572,48	22,26	-87,77	OT 5Y	-0,089	0,02	5,80
DIESEL	531,50	21,00	-97,00	OT 10Y	0,339	0,03	-4,80
COBRE	5.747,00	-183,00	-471,00	BUND 10Y	-0,969	4,55	-13,30
ZINCO	2.248,00	-99,00	-63,25	SCHATZ 2Y	0,007	0,69	-1,10
OURO	1.568,46	-11,76	57,90	T-NOTE 10Y	2,526	3,48	-18,30
TRIGO	571,50	-0,75	15,25	T-NOTE 2Y	1,939	3,43	-10,60
LICENÇA C02	24,64	0,05	-2,06	GILT 10Y	0,463	4,92	-21,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1005	-0,18%	-1,64%	1,1067	1,1128	1,1247
EUR/GBP	0,84603	-0,29%	0,72%	0,8484	0,8508	0,8554
EUR/JPY	120,02	0,08%	1,81%	120,02	120,02	120,02
EUR/CHF	1,0719	-0,33%	1,29%	1,0711	1,0703	1,0686
EUR/BRL	4,6314	0,16%	-2,73%	4,6738	4,7180	4,8275
EUR/PLN	4,2715	0,15%	-0,40%	4,2932	4,3163	4,3651



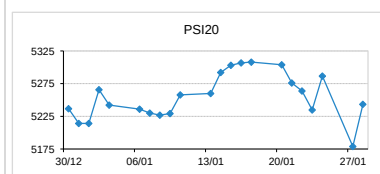
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1005	0,8460	120,02	1,0719	10,5942	7,4731	1,4502	1,63039	4,6314	10,0554
USD	0,9090	-	0,7703	109,135	0,9738	9,6330	6,7935	1,3183	1,4810	4,2111	9,1451

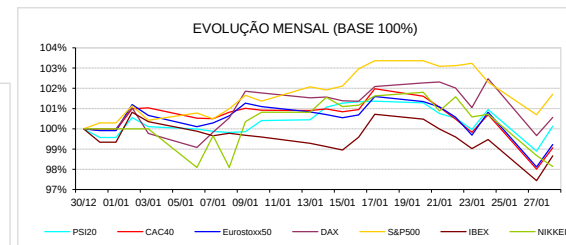
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,860	1,74	3,17
BCP	0,189	4,13	-6,66
CORT. AMORIM	11,020	1,47	-2,48
CTT	3,046	1,67	-4,51
EDP	4,314	1,63	11,65
EDP R	11,480	1,23	9,33
GALP	13,860	0,58	-6,98
IBERSOL	8,700	-0,23	8,75
J MARTINS	15,645	0,42	6,68
MOTA ENGIL	1,718	1,30	-8,13
NAVIGATOR	3,286	0,98	-4,71
NOS	4,818	0,17	0,37
NOVABASE	2,690	0,75	4,26
PHAROL	0,102	0,20	2,41
RAMADA	5,740	0,70	-1,71
REN	12,740	1,11	-7,14
SEMAPA	0,763	4,23	1,33
SONAE CAP.	0,857	1,84	-5,88
SONAE SGPS	5,740	0,70	-1,71

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SEMAPA	4,23
BCP	4,13
SONAE CAP.	1,84
ALTRI	1,74
CTT	1,67
IBERSOL	-0,23



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.243,32	1,24%	0,56%	5.429,32	4.699,20
CAC40	5.925,82	1,07%	-0,87%	6.109,81	4.878,62
ESTX 50 PR	3.719,22	1,13%	-0,69%	3.813,80	3.124,62
XTRA DAX	13.323,69	0,90%	0,56%	13.640,06	10.863,56
S&P 500	3.277,25	1,03%	1,43%	3.337,77	2.624,06
IBEX 35	9.484,20	1,26%	-0,68%	9.709,90	8.409,20
NIKKEI 225	23.215,71	-0,55%	-1,86%	24.115,95	20.110,76



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.