

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

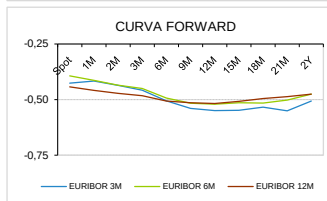
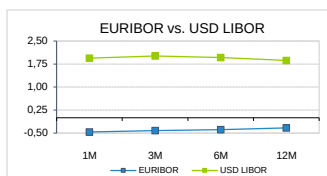
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

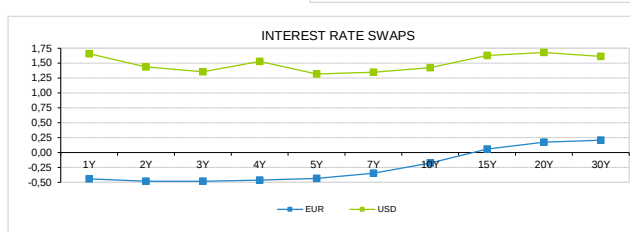
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4630	1	-1	1M	1,9403	-4	-11	0,7146	-0,8032
3M	-0,4170	1	2	3M	2,0120	-2	-12	0,7609	-0,7866
6M	-0,3870	0	4	6M	1,9604	1	-7	0,8166	-0,7356
12M	-0,3300	1	3	12M	1,8678	1	-8	0,8841	-0,6280

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4426	0	3	-0,5176	-0,3997	-0,1880
2Y	-0,4810	0	4	-0,4962	-0,3534	-0,1190
3Y	-0,4820	0	4	-0,4638	-0,2990	-0,0445
4Y	-0,4630	0	4	-0,4256	-0,2359	0,0255
5Y	-0,4340	0	3	-0,3776	-0,1681	0,0920
7Y	-0,3460	0	0	-0,2610	-0,0352	0,1994
10Y	-0,1760	0	-3	-0,0791	0,1221	0,3161
15Y	0,0580	0	-6	0,1326	0,2713	0,3943
20Y	0,1740	0	-8	0,2287	0,3160	0,3883
30Y	0,2070	0	-11	0,2413	0,2822	0,3127

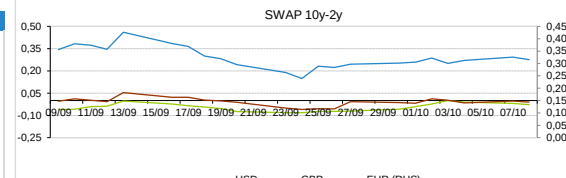
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



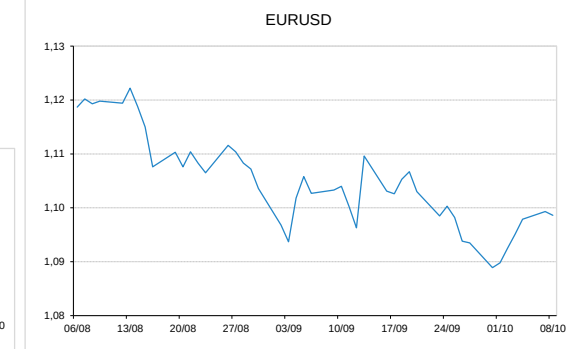
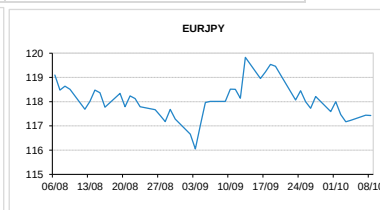
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,6580	-18	-7	1,2484	1,2426	1,3770
2Y	1,4360	0	-1	1,2284	1,2610	1,4065
3Y	1,3550	-21	3	1,2331	1,2960	1,4530
4Y	1,5290	-1	20	1,2515	1,3275	1,4890
5Y	1,3180	-20	5	1,2817	1,3740	1,5415
7Y	1,3470	-15	6	1,3280	1,4470	1,5700
10Y	1,4240	-16	7	1,4397	1,5170	1,6200
15Y	1,6300	-9	6	1,5372	1,6000	1,6620
20Y	1,6780	-9	5	1,5915	1,6245	1,6695
30Y	1,6140	-13	7	1,6167	1,6452	1,6575



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	57,94	-0,41	-2,63	OT 2Y	-0,613	0,01	4,30
JETFUEL	614,11	-10,10	1,08	OT 5Y	-0,289	-0,02	0,50
DIESEL	580,86	-8,60	0,08	OT 10Y	0,117	-0,02	-7,60
COBRE	5.707,50	79,00	-111,00	BUND 10Y	-1,043	-2,23	3,90
ZINCO	2.310,00	-28,50	-23,75	SCHATZ 2Y	-0,162	-1,14	8,70
OURO	1.501,95	2,15	-15,81	T-NOTE 10Y	2,410	-2,10	-3,40
TRIGO	494,75	5,50	31,00	T-NOTE 2Y	1,876	-1,90	-3,20
LICENÇA C02	22,57	-0,84	-2,51	GILT 10Y	0,408	-3,45	-9,20


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0986	-0,06%	-0,43%	1,1061	1,1126	1,1245
EUR/GBP	0,89795	-0,71%	-0,58%	0,9009	0,9039	0,9096
EUR/JPY	117,43	0,01%	0,49%	117,43	117,43	117,43
EUR/CHF	1,0885	0,35%	0,64%	1,0874	1,0863	1,0846
EUR/BRL	4,4715	0,77%	1,23%	4,5205	4,5660	4,6814
EUR/PLN	4,3226	0,18%	0,34%	4,3472	4,3716	4,4218

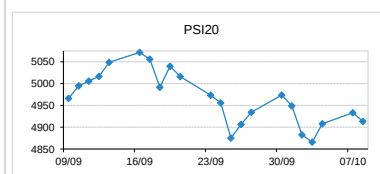

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0986	0,8980	117,43	1,0885	10,8905	7,4693	1,4598	1,62761	4,4715	10,0442
USD	0,9126	-	0,8187	107,085	0,9932	9,9311	6,8168	1,3325	1,4847	4,0821	9,1651

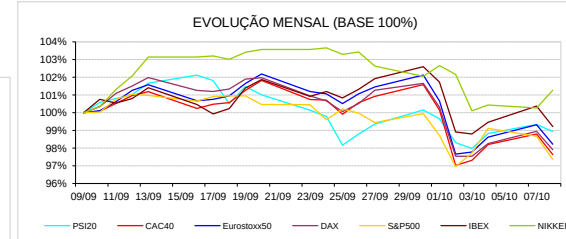
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,210	-3,34	-10,17
BCP	0,190	0,11	-17,04
CORT. AMORIM	9,560	2,14	6,22
CTT	2,144	0,47	-27,22
EDP	3,605	-1,42	18,24
EDP R	9,660	-1,43	24,24
GALP	13,485	-1,35	-2,25
IBERSOL	7,980	-0,75	1,01
J MARTINS	15,085	0,13	45,89
MOTA ENGIL	1,762	1,03	9,44
NAVIGATOR	3,052	0,26	-15,22
NOS	5,150	-0,19	-2,74
NOVABASE	2,780	0,72	37,62
PHAROL	0,105	-2,06	-35,78
RAMADA	6,020	1,01	-19,73
REN	11,400	0,88	-12,98
SEMAPA	0,608	-0,33	-28,39
SONAE CAP.	0,861	1,29	6,30
SONAE SGPS	6,020	1,01	-19,73

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	2,14
SONAE CAP.	1,29
MOTA ENGIL	1,03
RAMADA	1,01
RAMADA	1,01
GALP	-1,35
EDP	-1,42
EDP R	-1,43
PHAROL	-2,06
ALTRI	-3,34



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.913,35	-0,40%	3,84%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.456,62	-1,18%	15,35%	5.704,93	4.555,99
ESTX 50 PR	3.432,76	-1,11%	14,37%	3.588,68	2.908,70
XTRA DAX	11.970,20	-1,05%	13,37%	12.656,05	10.279,20
S&P 500	2.899,69	-1,32%	15,68%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	8.940,10	-1,15%	4,69%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	21.587,78	0,99%	7,86%	23.928,62	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.