

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

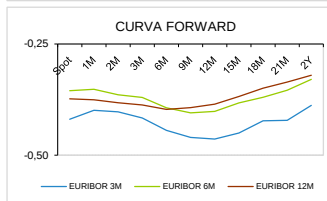
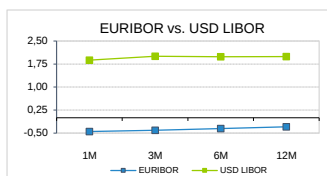
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

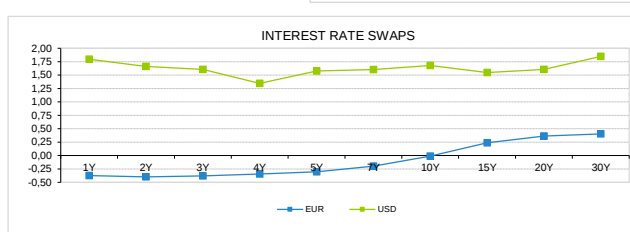
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4480	1	0	1M	1,8775	-1	-16	0,7118	-0,7948
3M	-0,4100	0	-1	3M	2,0033	0	-14	0,7836	-0,7776
6M	-0,3490	1	2	6M	1,9859	1	-9	0,8624	-0,7064
12M	-0,2940	1	1	12M	1,9923	2	-8	0,9568	-0,5800

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3730	0	3	-0,3852	-0,2194	0,0140
2Y	-0,3980	1	3	-0,3527	-0,1631	0,0827
3Y	-0,3810	2	4	-0,3080	-0,1063	0,1554
4Y	-0,3460	2	5	-0,2577	-0,0414	0,2266
5Y	-0,3040	3	5	-0,2046	0,0269	0,2940
7Y	-0,1970	3	4	-0,0812	0,1611	0,4042
10Y	-0,0110	4	3	0,1066	0,3233	0,5236
15Y	0,2380	4	0	0,3270	0,4769	0,6053
20Y	0,3620	4	-1	0,4283	0,5241	0,6003
30Y	0,4030	4	-2	0,4425	0,4887	0,5201

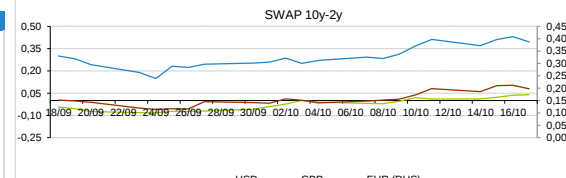
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7950	0	-15	1,4872	1,4825	1,6135
2Y	1,6600	0	-12	1,4680	1,5060	1,6540
3Y	1,6040	1	-10	1,4730	1,5400	1,6920
4Y	1,3450	-1	-3	1,4870	1,5775	1,7270
5Y	1,5760	1	-9	1,5110	1,6170	1,7864
7Y	1,6020	11	6	1,5730	1,6890	1,8190
10Y	1,6770	1	-8	1,6675	1,7700	1,8740
15Y	1,5480	-8	9	1,7735	1,8465	1,9145
20Y	1,6040	-7	9	1,8180	1,8700	1,9170
30Y	1,8470	1	-8	1,8415	1,8740	1,9000

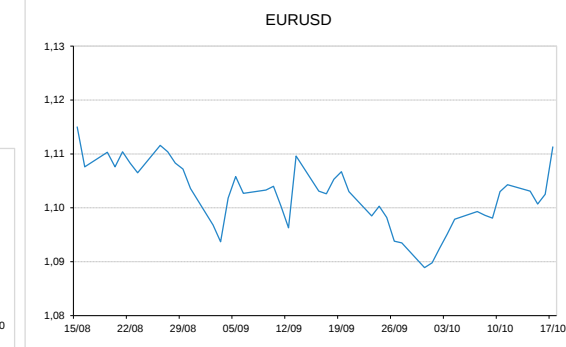
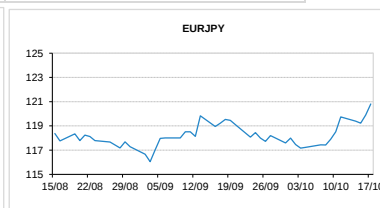
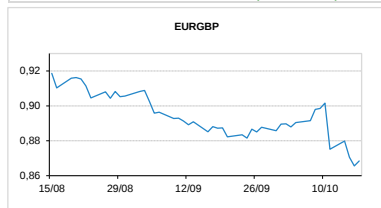


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	58,99	-0,43	-4,57	OT 2Y	-0,567	0,01	-5,60
JETFUEL	629,74	5,98	-52,43	OT 5Y	-0,233	-0,02	-5,80
DIESEL	595,25	4,75	-46,42	OT 10Y	0,182	-0,02	-12,90
COBRE	5.721,50	-43,00	-140,00	BUND 10Y	-0,846	-1,24	7,60
ZINCO	2.469,50	6,25	102,25	SCHATZ 2Y	-0,044	1,15	5,00
OURO	1.493,64	4,71	-12,22	T-NOTE 10Y	2,582	0,30	-6,60
TRIGO	525,50	12,25	41,25	T-NOTE 2Y	2,024	-0,19	-9,00
LICENÇA C02	25,83	-0,47	-0,39	GILT 10Y	0,684	0,09	-0,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1113	0,80%	0,79%	1,1186	1,1249	1,1373
EUR/GBP	0,8684	-0,32%	2,27%	0,8714	0,8742	0,8802
EUR/JPY	120,81	-0,75%	-1,31%	120,81	120,81	120,81
EUR/CHF	1,0987	0,34%	-0,02%	1,0976	1,0965	1,0948
EUR/BRL	4,6147	-0,35%	-2,19%	4,6622	4,7034	4,8107
EUR/PLN	4,2823	0,05%	1,37%	4,3063	4,3299	4,3786



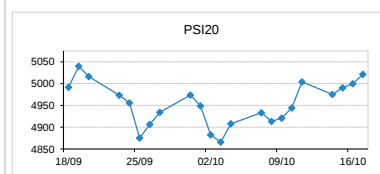
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1113	0,8684	120,81	1,0987	10,8043	7,4704	1,4610	1,6301	4,6147	10,2143
USD	0,8996	-	0,7783	108,635	0,9876	9,7026	6,7207	1,3137	1,4664	4,1360	9,1726

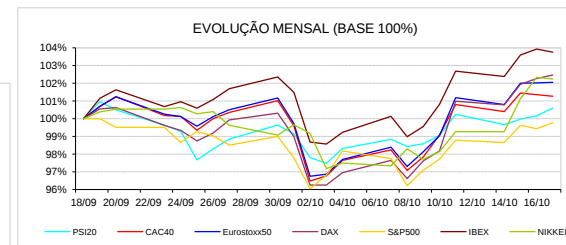
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,395	0,65	-7,07
BCP	0,199	-0,30	-13,12
CORT. AMORIM	9,870	1,65	9,67
CTT	2,332	2,91	-20,84
EDP	3,525	-1,67	15,61
EDP R	9,760	0,72	25,53
GALP	13,585	0,30	-1,49
IBERSOL	7,240	-2,16	-8,35
J MARTINS	15,145	0,40	46,47
MOTA ENGIL	1,992	1,27	23,73
NAVIGATOR	3,308	0,43	-8,11
NOS	5,335	3,39	0,76
NOVABASE	2,470	0,82	22,28
PHAROL	0,102	0,20	-37,38
RAMADA	6,380	1,92	-14,93
REN	12,580	1,29	-3,97
SEMAPA	0,685	0,88	-19,32
SONAE CAP.	0,914	0,00	12,84
SONAE SGPS	6,380	1,92	-14,93

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOS	3,39
CTT	2,91
RAMADA	1,92
RAMADA	1,92
CORT. AMORIM	1,65
BCP	-0,30
EDP	-1,67
IBERSOL	-2,16



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.021,33	0,43%	6,13%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.692,00	-0,09%	20,32%	5.737,15	4.555,99
ESTX 50 PR	3.600,46	0,03%	19,96%	3.630,43	2.908,70
XTRA DAX	12.694,75	0,20%	20,23%	12.814,49	10.279,20
S&P 500	2.999,74	0,34%	19,67%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	9.370,40	-0,17%	9,73%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	22.451,86	-0,09%	12,18%	22.959,41	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.