

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

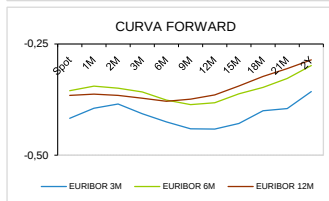
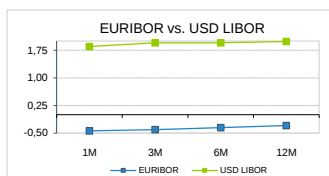
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

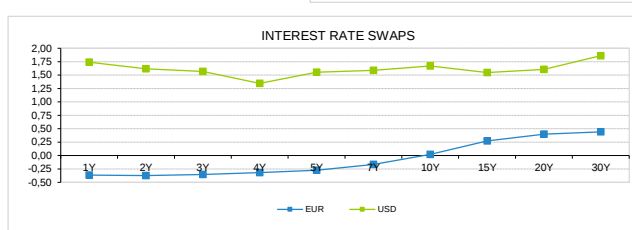
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4380	0	2	1M	1,8503	0	-19	0,7105	-0,7948
3M	-0,4080	0	-2	3M	1,9533	-1	-20	0,7938	-0,7750
6M	-0,3490	0	1	6M	1,9518	-2	-13	0,8800	-0,7060
12M	-0,2940	0	0	12M	1,9873	-1	-8	0,9858	-0,5756

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3654	0	4	-0,3644	-0,1764	0,0892
2Y	-0,3740	0	7	-0,3253	-0,1199	0,1659
3Y	-0,3520	0	9	-0,2767	-0,0462	0,2430
4Y	-0,3190	0	10	-0,2219	0,0260	0,3150
5Y	-0,2740	-1	11	-0,1586	0,1000	0,3860
7Y	-0,1650	-1	12	-0,0213	0,2406	0,4980
10Y	0,0200	-1	11	0,1770	0,4092	0,6214
15Y	0,2730	-2	11	0,4069	0,5658	0,7051
20Y	0,3990	-2	10	0,5141	0,6182	0,7001
30Y	0,4410	-2	10	0,5332	0,5858	0,6218

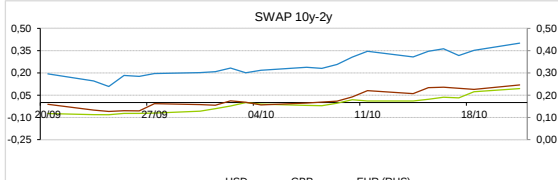
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7410	-2	-15	1,5145	1,5055	1,6865
2Y	1,6160	-2	-7	1,4810	1,5670	1,7009
3Y	1,5670	-2	-4	1,4920	1,6075	1,7485
4Y	1,3450	-1	-3	1,5035	1,6190	1,8190
5Y	1,5520	-1	-2	1,5385	1,6640	1,8776
7Y	1,5870	-1	-8	1,6100	1,7425	1,8713
10Y	1,6710	0	3	1,7550	1,8235	1,9280
15Y	1,5480	-8	9	1,8400	1,8868	1,9495
20Y	1,6040	-7	9	1,8890	1,9085	1,9648
30Y	1,8610	0	6	1,8900	1,9265	1,9451

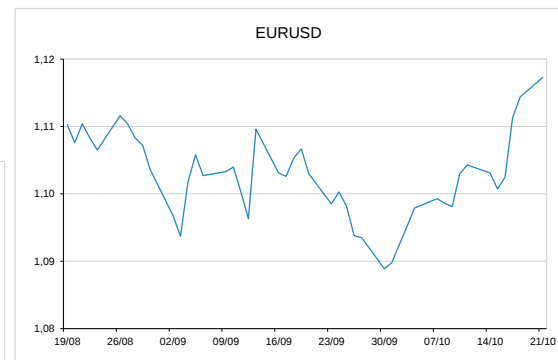
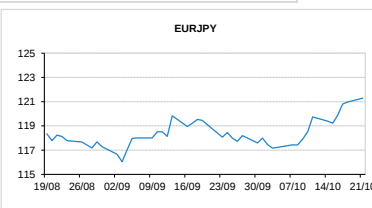
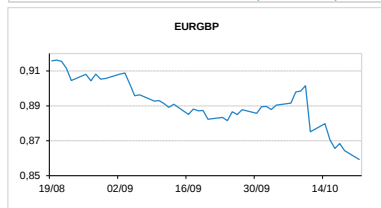


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	58,52	-0,90	-4,68	OT 2Y	-0,559	0,01	-2,30
JETFUEL	623,99	-5,02	-44,34	OT 5Y	-0,192	0,03	2,00
DIESEL	588,00	-6,25	-33,33	OT 10Y	0,237	0,04	-2,80
COBRE	5.820,00	67,00	-8,00	BUND 10Y	-0,785	4,22	16,70
ZINCO	2.491,00	16,00	168,25	SCHATZ 2Y	-0,034	1,37	6,40
OURO	1.486,44	-5,57	-16,99	T-NOTE 10Y	2,616	4,12	-0,10
TRIGO	525,50	-6,75	41,25	T-NOTE 2Y	2,040	2,86	-5,90
LICENÇA C02	25,95	0,07	-0,58	GILT 10Y	0,742	3,64	11,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1173	0,26%	1,71%	1,1246	1,1310	1,1434
EUR/GBP	0,8593	0,59%	2,81%	0,8622	0,8651	0,8710
EUR/JPY	121,29	-0,26%	-2,65%	121,29	121,29	121,29
EUR/CHF	1,0995	-0,01%	-1,10%	1,0985	1,0975	1,0958
EUR/BRL	4,6123	-0,40%	-0,70%	4,6606	4,7017	4,8131
EUR/PLN	4,2784	0,08%	2,64%	4,3028	4,3264	4,3751



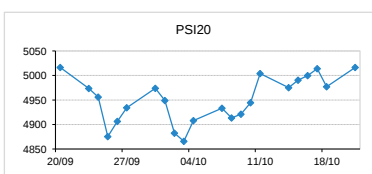
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1173	0,8593	121,29	1,0995	10,7305	7,4713	1,4603	1,62341	4,6123	10,1817
USD	0,8971	-	0,7699	108,535	0,9866	9,6160	6,7025	1,3102	1,4572	4,1381	9,1236

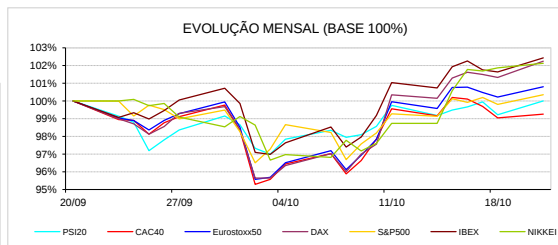
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,510	2,89	-5,00
BCP	0,202	3,96	-11,98
CORT. AMORIM	9,970	1,22	10,78
CTT	2,460	4,50	-16,50
EDP	3,550	0,85	16,43
EDP R	9,840	1,34	26,56
GALP	13,510	-0,15	-2,07
IBERSOL	7,520	-0,53	-4,81
J MARTINS	14,670	-1,97	41,88
MOTA ENGIL	1,978	2,12	22,86
NAVIGATOR	3,336	1,89	-7,33
NOS	5,300	0,86	0,09
NOVABASE	2,490	1,63	23,27
PHAROL	0,102	0,00	-37,25
RAMADA	6,280	0,64	-16,27
REN	12,820	1,91	-2,14
SEMAPA	0,689	0,15	-18,85
SONAE CAP.	0,903	-0,33	11,42
SONAE SGPS	6,280	0,64	-16,27

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	4,50
BCP	3,96
ALTRI	2,89
MOTA ENGIL	2,12
REN	1,91
GALP	-0,15
SONAE CAP.	-0,33
IBERSOL	-0,53
J MARTINS	-1,97



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.016,45	0,79%	6,02%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.648,35	0,21%	19,40%	5.737,15	4.555,99
ESTX 50 PR	3.600,08	0,58%	19,95%	3.630,43	2.908,70
XTRA DAX	12.747,96	0,91%	20,73%	12.814,49	10.279,20
S&P 500	3.002,70	0,55%	19,78%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	9.402,30	0,78%	10,10%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	22.548,90	0,25%	12,66%	22.698,79	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.