

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

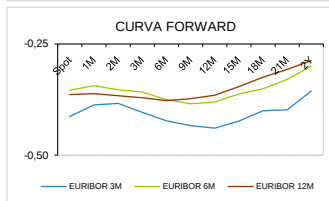
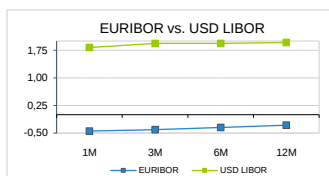
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

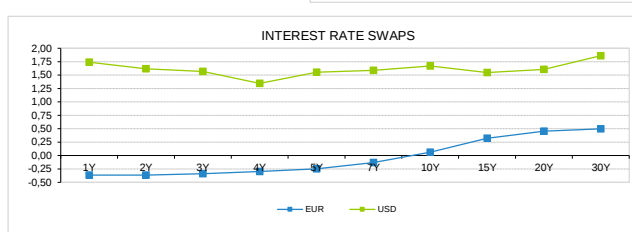
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,4440	-1	1	1M	1,8230	-3	-21	0,7111
3M	-0,4040	0	-1	3M	1,9340	-2	-20	0,7954
6M	-0,3480	0	1	6M	1,9343	-2	-14	0,8843
12M	-0,2840	1	1	12M	1,9606	-3	-10	0,9915
								-0,5698

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3640	0	4	-0,3651	-0,1858	0,0699
2Y	-0,3650	1	6	-0,3260	-0,1255	0,1363
3Y	-0,3380	1	9	-0,2789	-0,0604	0,2105
4Y	-0,2970	2	11	-0,2249	0,0055	0,2794
5Y	-0,2480	3	13	-0,1658	0,0732	0,3433
7Y	-0,1320	3	16	-0,0408	0,2063	0,4477
10Y	0,0630	4	18	0,1473	0,3650	0,5661
15Y	0,3230	5	19	0,3645	0,5129	0,6428
20Y	0,4530	5	20	0,4641	0,5616	0,6375
30Y	0,4980	6	20	0,4793	0,5273	0,5597

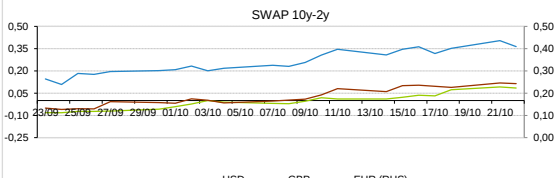
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7410	-2	-15	1,5059	1,5480	1,6795
2Y	1,6160	-2	-7	1,4680	1,5785	1,6930
3Y	1,5670	-2	-4	1,4820	1,5760	1,7540
4Y	1,3450	-1	-3	1,5040	1,6460	1,7960
5Y	1,5520	-1	-2	1,5325	1,6560	1,8551
7Y	1,5870	-1	-8	1,5990	1,7325	1,8760
10Y	1,6710	0	3	1,7452	1,8491	1,9105
15Y	1,5480	-8	9	1,8240	1,9020	1,9685
20Y	1,6040	-7	9	1,8902	1,9270	1,9510
30Y	1,8610	0	6	1,8920	1,9230	1,9460

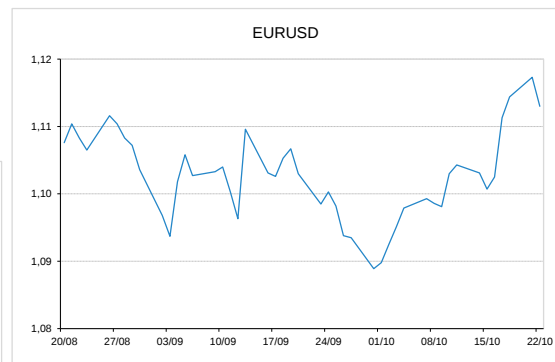
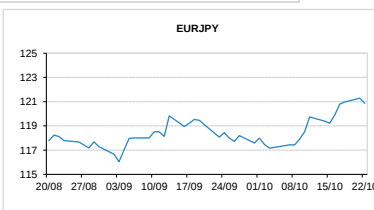
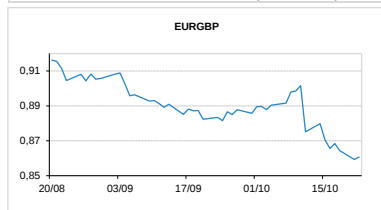


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	60,02	1,06	-3,18	OT 2Y	-0,547	0,01	-2,20
JETFUEL	623,99	-5,02	-44,34	OT 5Y	-0,207	-0,02	1,80
DIESEL	588,00	-6,25	-33,33	OT 10Y	0,211	-0,03	-3,80
COBRE	5.841,00	22,00	30,00	BUND 10Y	-0,816	-2,98	14,70
ZINCO	2.508,00	17,00	197,50	SCHATZ 2Y	-0,032	0,00	6,60
OURO	1.483,81	-0,75	-19,62	T-NOTE 10Y	2,614	0,00	0,60
TRIGO	522,75	-0,75	38,50	T-NOTE 2Y	2,045	0,00	-4,80
LICENÇA C02	25,68	-0,25	-0,85	GILT 10Y	0,699	-3,90	7,20



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,113	-0,38%	1,32%	1,1204	1,1267	1,1392
EUR/GBP	0,86065	-0,16%	2,65%	0,8636	0,8664	0,8724
EUR/JPY	120,87	0,35%	-3,22%	120,87	120,87	120,87
EUR/CHF	1,1014	-0,17%	-1,27%	1,1004	1,0994	1,0976
EUR/BRL	4,5314	1,59%	1,05%	4,5778	4,6189	4,7472
EUR/PLN	4,2712	0,13%	2,81%	4,2957	4,3190	4,3672



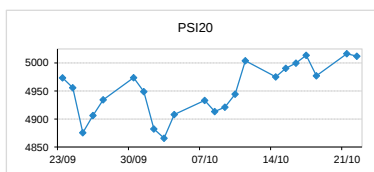
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1130	0,8607	120,87	1,1014	10,7278	7,4702	1,4577	1,62251	4,5314	10,1781
USD	0,8984	-	0,7747	108,55	0,9887	9,6477	6,7123	1,3091	1,4571	4,0834	9,1503

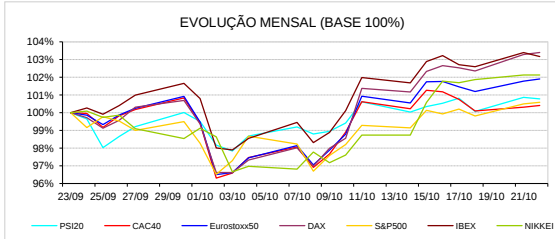
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,465	-0,82	-5,78
BCP	0,198	-1,93	-13,68
CORT. AMORIM	9,960	-0,10	10,67
CTT	2,426	-1,38	-17,65
EDP	3,554	0,11	16,56
EDP R	9,930	0,91	27,72
GALP	13,710	1,48	-0,62
IBERSOL	7,600	1,06	-3,80
J MARTINS	14,760	0,61	42,75
MOTA ENGL	1,951	-1,37	21,18
NAVIGATOR	3,310	-0,78	-8,06
NOS	5,275	-0,47	-0,38
NOVABASE	2,570	3,21	27,23
PHAROL	0,101	-1,17	-37,99
RAMADA	6,320	0,64	-15,73
REN	12,720	-0,78	-2,90
SEMAPA	0,685	-0,58	-19,32
SONAE CAP.	0,899	-0,39	10,99
SONAE SGPS	6,320	0,64	-15,73

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOVABASE	3,21
GALP	1,48
IBERSOL	1,06
EDP R	0,91
RAMADA	0,64
ALTRI	-0,82
PHAROL	-1,17
MOTA ENGL	-1,37
CTT	-1,38
BCP	-1,93



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.012,02	-0,09%	5,93%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.653,93	0,10%	19,52%	5.737,15	4.555,99
ESTX 50 PR	3.604,27	0,12%	20,09%	3.630,43	2.908,70
XTRA DAX	12.761,95	0,11%	20,86%	12.814,49	10.279,20
S&P 500	3.009,31	0,09%	20,04%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	9.382,10	-0,21%	9,86%	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.