

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

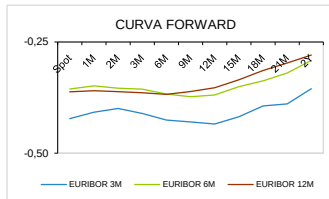
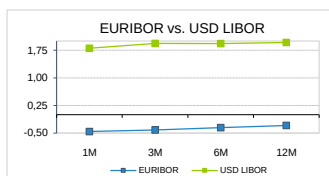
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

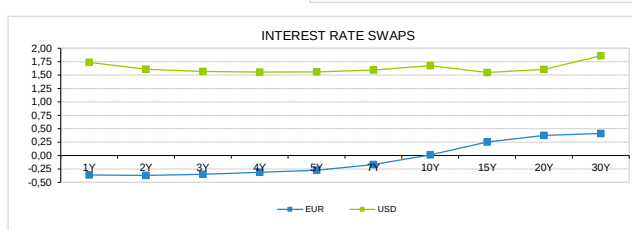
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4560	-1	0	1M	1,8043	-2	-24	0,7144	-0,7784
3M	-0,4130	-1	0	3M	1,9356	0	-18	0,8051	-0,7670
6M	-0,3500	0	3	6M	1,9320	2	-13	0,8784	-0,6910
12M	-0,2930	-1	3	12M	1,9609	2	-7	0,9741	-0,5572

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3610	0	5	-0,3529	-0,1774	0,0651
2Y	-0,3710	0	6	-0,3182	-0,1185	0,1388
3Y	-0,3490	0	9	-0,2707	-0,0570	0,2099
4Y	-0,3130	1	11	-0,2179	0,0104	0,2780
5Y	-0,2730	1	13	-0,1614	0,0787	0,3430
7Y	-0,1680	1	17	-0,0342	0,2113	0,4492
10Y	0,0120	1	18	0,1526	0,3725	0,5736
15Y	0,2530	1	20	0,3724	0,5222	0,6542
20Y	0,3740	1	21	0,4748	0,5715	0,6480
30Y	0,4110	1	22	0,4881	0,5347	0,5661

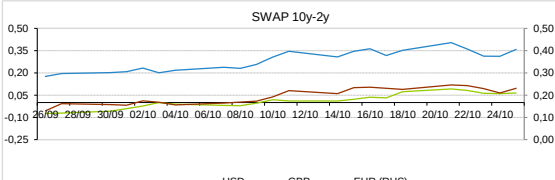
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



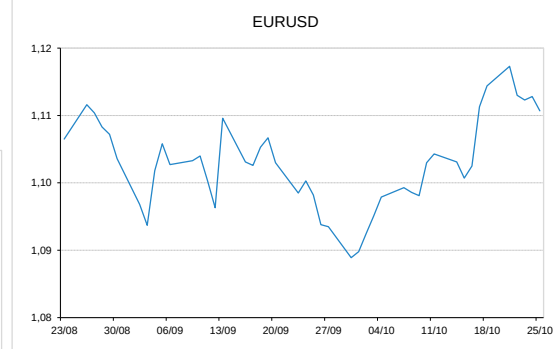
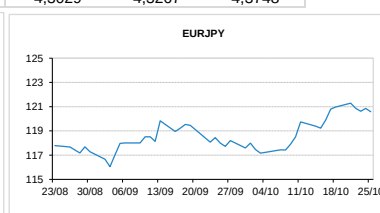
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7360	-1	-11	1,5103	1,4790	1,6500
2Y	1,6090	-2	-2	1,5010	1,5525	1,6735
3Y	1,5670	-2	3	1,5025	1,5695	1,7000
4Y	1,5550	-2	5	1,5270	1,6190	1,7650
5Y	1,5580	-2	7	1,5350	1,6195	1,8259
7Y	1,5930	-3	10	1,5725	1,6965	1,8280
10Y	1,6750	-3	13	1,7070	1,7940	1,8825
15Y	1,5480	-8	9	1,7910	1,8840	1,9380
20Y	1,6040	-7	9	1,8240	1,8950	1,9405
30Y	1,8590	-4	16	1,8635	1,8780	1,9195



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	61,67	0,00	0,24	OT 2Y	-0,520	0,02	3,80
JETFUEL	634,00	-3,60	-10,75	OT 5Y	-0,183	0,02	10,30
DIESEL	602,10	-3,15	-0,15	OT 10Y	0,210	0,03	5,20
COBRE	5.884,00	-1,00	100,00	BUND 10Y	-0,817	3,38	20,70
ZINCO	2.534,00	28,00	243,25	SCHATZ 2Y	-0,030	1,60	8,70
OURO	1.508,54	7,40	3,07	T-NOTE 10Y	2,604	1,07	2,20
TRIGO	521,25	5,25	44,00	T-NOTE 2Y	2,059	2,48	-0,40
LICENÇA C02	25,02	-0,42	-0,19	GILT 10Y	0,654	3,43	13,20


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1107	-0,19%	1,14%	1,1180	1,1243	1,1365
EUR/GBP	0,86598	-0,36%	2,39%	0,8689	0,8718	0,8775
EUR/JPY	120,59	0,22%	-2,15%	120,59	120,59	120,59
EUR/CHF	1,1016	0,07%	-1,52%	1,1006	1,0996	1,0978
EUR/BRL	4,43	1,34%	2,47%	4,4742	4,5149	4,6200
EUR/PLN	4,2777	-0,07%	2,45%	4,3029	4,3267	4,3748

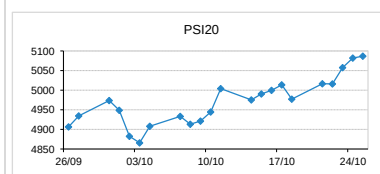

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1107	0,8660	120,59	1,1016	10,7395	7,4702	1,4482	1,6223	4,4300	10,1884
USD	0,9017	-	0,7793	108,575	0,9934	9,6862	6,7355	1,3063	1,4645	4,0187	9,1886

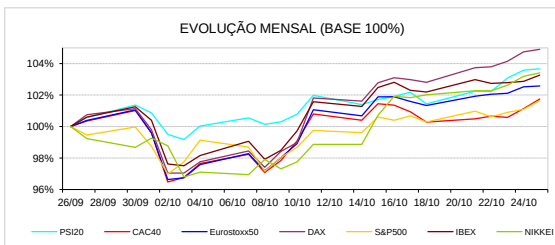
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,510	1,10	-5,09
BCP	0,203	-0,25	-11,50
CORT. AMORIM	9,760	-1,31	8,44
CTT	2,642	0,38	-10,32
EDP	3,628	-0,36	18,99
EDP R	9,910	0,41	27,46
GALP	14,250	0,88	3,30
IBERSOL	7,600	-0,52	-3,80
J MARTINS	14,900	-0,13	44,10
MOTA ENGIL	2,012	-0,10	24,97
NAVIGATOR	3,302	-0,84	-8,28
NOS	5,320	1,43	0,47
NOVABASE	2,560	0,39	26,73
PHAROL	0,101	-0,20	-37,99
RAMADA	6,100	-3,79	-18,67
REN	12,640	-0,47	-3,51
SEMAPA	0,690	-0,29	-18,73
SONAE CAP.	0,909	-0,16	12,16
SONAE SGPS	6,100	-3,79	-18,67

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOS	1,43
ALTRI	1,10
GALP	0,88
EDP R	0,41
NOVABASE	0,39
IBERSOL	-0,52
NAVIGATOR	-0,84
CORT. AMORIM	-1,31
RAMADA	-3,79
RAMADA	-3,79



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.086,33	0,09%	7,51%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.718,23	0,61%	20,89%	5.737,15	4.555,99
ESTX 50 PR	3.623,00	0,05%	20,72%	3.631,04	2.908,70
XTRA DAX	12.891,39	0,15%	22,09%	12.914,24	10.279,20
S&P 500	3.026,61	0,54%	20,74%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	9.428,00	0,39%	10,40%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	22.799,81	0,22%	13,91%	22.819,92	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.