

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

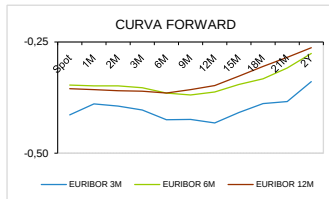
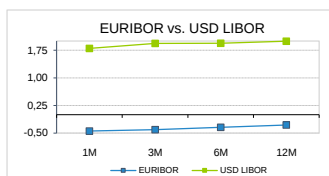
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

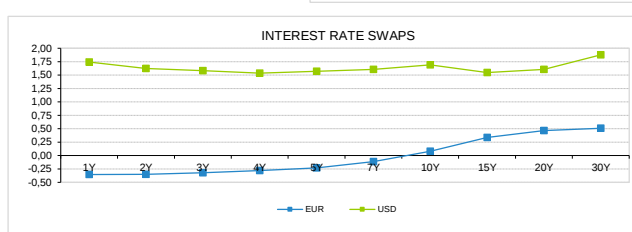
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4430	0	2	1M	1,7996	-1	-23	0,7116	-0,7860
3M	-0,4050	0	1	3M	1,9355	1	-16	0,8036	-0,7608
6M	-0,3430	0	3	6M	1,9399	1	-12	0,8674	-0,6918
12M	-0,2800	0	5	12M	1,9953	4	-5	0,9628	-0,5554

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3545	0	7	-0,3471	-0,1638	0,0815
2Y	-0,3490	1	10	-0,3069	-0,1050	0,1559
3Y	-0,3200	2	13	-0,2593	-0,0419	0,2260
4Y	-0,2800	2	15	-0,2048	0,0260	0,2949
5Y	-0,2310	3	17	-0,1472	0,0940	0,3590
7Y	-0,1140	4	21	-0,0202	0,2260	0,4690
10Y	0,0780	5	24	0,1685	0,3888	0,5940
15Y	0,3360	7	28	0,3924	0,5453	0,6730
20Y	0,4650	7	31	0,4930	0,5918	0,6688
30Y	0,5080	8	33	0,5050	0,5518	0,5830

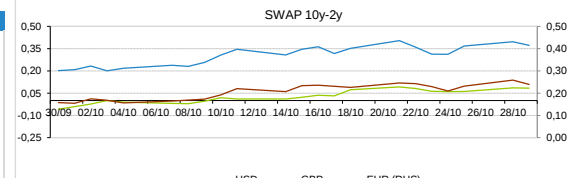
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7420	2	-10	1,5590	1,5843	1,7100
2Y	1,6240	3	-1	1,5520	1,6010	1,7641
3Y	1,5820	3	4	1,5535	1,6375	1,8068
4Y	1,5360	-2	3	1,5822	1,6750	1,8476
5Y	1,5710	3	8	1,6020	1,7130	1,8862
7Y	1,6050	3	11	1,6570	1,7870	1,9387
10Y	1,6900	3	14	1,7630	1,8670	1,9710
15Y	1,5480	-8	9	1,8565	1,9410	2,0110
20Y	1,6040	-7	9	1,9140	1,9600	2,0015
30Y	1,8770	3	18	1,9350	1,9801	2,0026

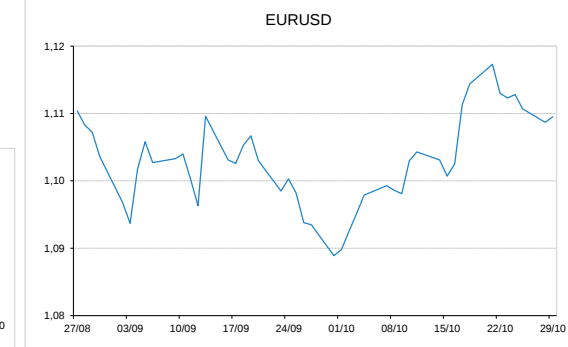
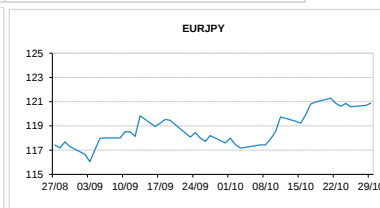
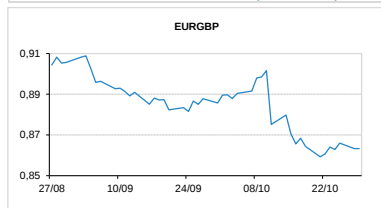


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	61,84	0,27	0,80	OT 2Y	-0,524	-0,03	6,80
JETFUEL	629,21	-4,79	-21,29	OT 5Y	-0,168	-0,02	13,30
DIESEL	597,00	-5,10	-11,42	OT 10Y	0,227	-0,03	6,00
COBRE	5.917,00	-17,00	141,00	BUND 10Y	-0,799	-2,63	21,50
ZINCO	2.590,50	35,50	265,00	SCHATZ 2Y	-0,014	0,46	13,50
OURO	1.489,23	-3,89	-13,00	T-NOTE 10Y	2,651	-0,92	11,10
TRIGO	510,50	-1,25	23,25	T-NOTE 2Y	2,097	-0,57	7,80
LICENÇA C02	25,60	0,48	0,30	GILT 10Y	0,696	-0,89	19,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1095	0,07%	1,89%	1,1167	1,1230	1,1354
EUR/GBP	0,86328	0,00%	2,60%	0,8662	0,8690	0,8750
EUR/JPY	120,88	-0,16%	-2,72%	120,88	120,88	120,88
EUR/CHF	1,1040	0,04%	-1,45%	1,1029	1,1020	1,1003
EUR/BRL	4,4397	-0,20%	2,04%	4,4872	4,5274	4,6317
EUR/PLN	4,2642	0,20%	2,50%	4,2891	4,3123	4,3600



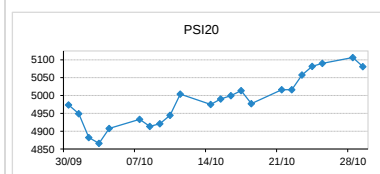
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1095	0,8633	120,88	1,1040	10,7904	7,4710	1,4540	1,6187	4,4397	10,2600
USD	0,9000	-	0,7762	108,94	0,9942	9,7138	6,7238	1,3068	1,4566	3,9978	9,2351

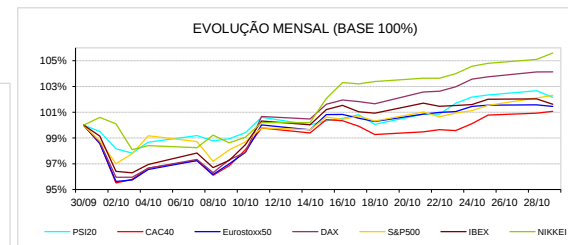
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,455	-1,27	-5,95
BCP	0,203	0,15	-11,68
CORT. AMORIM	9,750	-1,71	8,33
CTT	2,672	0,30	-9,30
EDP	3,592	-0,55	17,81
EDP R	9,730	-1,82	25,14
GALP	14,535	-0,38	5,36
IBERSOL	7,500	-1,32	-5,06
J MARTINS	14,935	-0,27	44,44
MOTA ENGIL	1,979	-1,35	22,92
NAVIGATOR	3,248	-1,52	-9,78
NOS	5,315	0,00	0,38
NOVABASE	2,510	0,00	24,26
PHAROL	0,099	-1,59	-39,34
RAMADA	6,380	0,63	-14,93
REN	12,500	-1,57	-4,58
SEMAPA	0,703	-0,85	-17,20
SONAE CAP.	0,912	-0,11	12,59
SONAE SGPS	6,380	0,63	-14,93

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
RAMADA	0,63
RAMADA	0,63
CTT	0,30
BCP	0,15
NAVIGATOR	-1,52
REN	-1,57
PHAROL	-1,59
CORT. AMORIM	-1,71
EDP R	-1,82



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.080,98	-0,50%	7,39%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.738,51	0,14%	21,30%	5.747,10	4.555,99
ESTX 50 PR	3.621,38	-0,12%	20,66%	3.637,94	2.908,70
XTRA DAX	12.942,07	0,00%	22,57%	12.986,49	10.279,20
S&P 500	3.045,55	0,20%	21,48%	3.047,87	2.346,58
IBEX 35	9.394,00	-0,41%	10,00%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	22.974,13	0,47%	14,79%	23.008,43	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.