

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

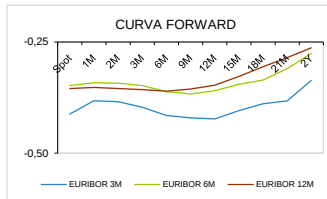
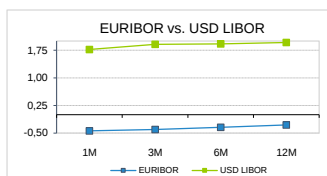
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

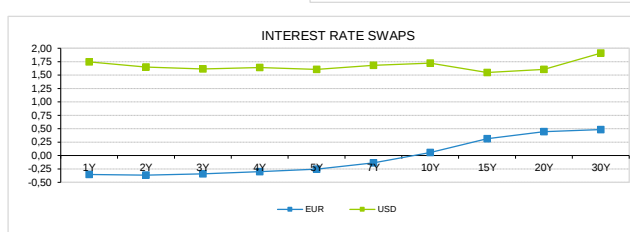
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4380	1	4	1M	1,7710	0	-21	0,7136	-0,7438
3M	-0,4030	-1	2	3M	1,9083	2	-12	0,8046	-0,7156
6M	-0,3440	0	5	6M	1,9246	2	-3	0,8899	-0,6582
12M	-0,2780	0	6	12M	1,9600	3	11	0,9720	-0,5350

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3540	1	9	-0,3467	-0,1470	0,1321
2Y	-0,3660	-1	11	-0,3072	-0,0810	0,2125
3Y	-0,3410	-1	14	-0,2530	-0,0100	0,2875
4Y	-0,3020	0	16	-0,1930	0,0660	0,3610
5Y	-0,2540	0	18	-0,1270	0,1400	0,4270
7Y	-0,1360	2	21	0,0140	0,2810	0,5410
10Y	0,0550	3	23	0,2150	0,4522	0,6670
15Y	0,3140	4	26	0,4499	0,6141	0,7490
20Y	0,4440	5	27	0,5561	0,6610	0,7420
30Y	0,4840	5	28	0,5677	0,6208	0,6566

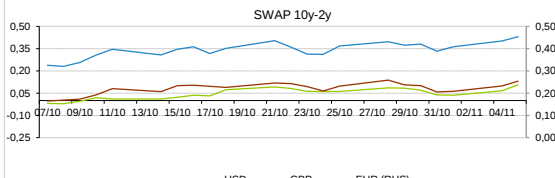
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,00
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7460	-4	-9	1,5678	1,5100	1,7707
2Y	1,6500	-3	1	1,5650	1,6260	1,7920
3Y	1,6150	-4	5	1,5892	1,6650	1,8360
4Y	1,6390	10	10	1,5920	1,7060	1,8760
5Y	1,6050	-4	9	1,6240	1,7658	1,9335
7Y	1,6820	8	19	1,6925	1,8455	1,9620
10Y	1,7230	-5	14	1,8134	1,9212	1,9270
15Y	1,5480	-8	9	1,8950	1,9650	2,0645
20Y	1,6040	-7	9	1,9380	2,0147	2,0628
30Y	1,9090	-5	17	1,9540	1,9950	2,0220

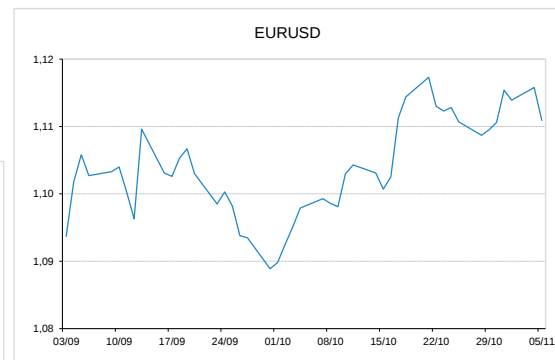
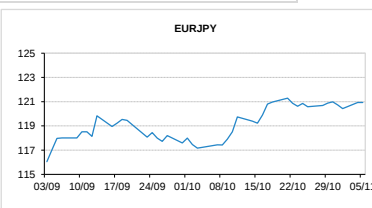
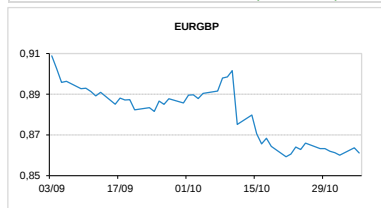


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,82	0,69	5,08	OT 2Y	-0,553	-0,02	6,30
JETFUEL	628,89	0,72	10,99	OT 5Y	-0,180	0,00	7,70
DIESEL	590,78	-0,87	9,38	OT 10Y	0,249	0,02	10,80
COBRE	5.883,00	27,00	234,00	BUND 10Y	-0,757	3,61	27,60
ZINCO	2.604,00	24,00	280,50	SCHATZ 2Y	-0,011	0,92	14,70
OURO	1.482,26	-27,49	-26,21	T-NOTE 10Y	2,683	6,44	29,00
TRIGO	511,50	1,75	21,00	T-NOTE 2Y	2,112	3,83	28,20
LICENÇA C02	25,55	-0,08	2,61	GILT 10Y	0,757	5,77	32,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1109	-0,44%	1,06%	1,1178	1,1239	1,1365
EUR/GBP	0,86113	0,30%	3,53%	0,8640	0,8668	0,8729
EUR/JPY	120,93	0,00%	-2,89%	120,93	120,93	120,93
EUR/CHF	1,0994	-0,01%	-0,65%	1,0986	1,0978	1,0964
EUR/BRL	4,4151	1,28%	2,03%	4,4649	4,5048	4,6077
EUR/PLN	4,2661	0,03%	1,51%	4,2902	4,3136	4,3629



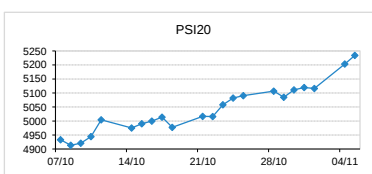
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1109	0,8611	120,93	1,0994	10,7051	7,4720	1,4587	1,60641	4,4151	10,1767
USD	0,9031	-	0,777	109,135	0,9918	9,6550	6,7474	1,3157	1,4504	3,9995	9,1890

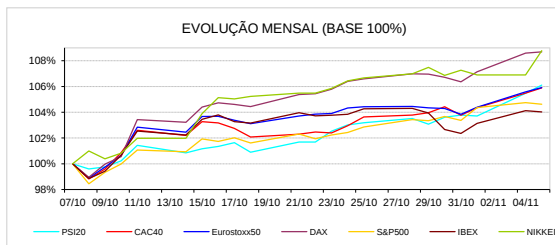
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,925	0,51	2,16
BCP	0,211	1,44	-7,97
CORT. AMORIM	10,080	0,80	12,00
CTT	3,000	6,91	1,83
EDP	3,709	0,00	21,65
EDP R	10,160	-0,59	30,68
GALP	14,780	1,06	7,14
IBERSOL	7,460	-0,53	-5,57
J MARTINS	15,095	-0,23	45,99
MOTA ENGIL	2,078	-0,29	29,07
NAVIGATOR	3,490	1,34	-3,06
NOS	5,310	-0,38	0,28
NOVABASE	2,700	7,57	33,66
PHAROL	0,100	2,88	-38,73
RAMADA	6,300	-1,25	-16,00
REN	12,840	1,10	-1,98
SEMAPA	0,730	2,24	-14,02
SONAE CAP.	0,936	2,18	15,56
SONAE SGPS	6,300	-1,25	-16,00

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOVABASE	7,57
CTT	6,91
PHAROL	2,88
SEMAPA	2,24
SONAE CAP.	2,18
NOS	-0,38
IBERSOL	-0,53
EDP R	-0,59
RAMADA	-1,25
RAMADA	-1,25



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.234,42	0,60%	10,63%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.846,89	0,39%	23,59%	5.850,01	4.555,99
ESTX 50 PR	3.676,52	0,31%	22,49%	3.678,63	2.908,70
XTRA DAX	13.148,50	0,09%	24,52%	13.171,17	10.279,20
S&P 500	3.074,96	-0,12%	22,65%	3.085,20	2.346,58
IBEX 35	9.407,90	-0,09%	10,16%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	23.251,99	1,76%	16,17%	23.328,52	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.