

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

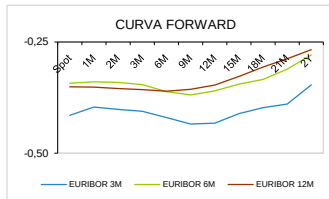
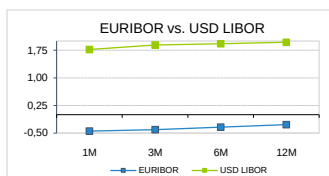
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

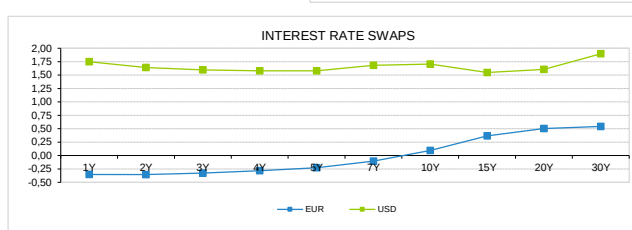
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4450	-1	3	1M	1,7699	0	-21	0,7159	-0,7350
3M	-0,4060	0	2	3M	1,8935	-1	-13	0,8045	-0,7000
6M	-0,3390	1	5	6M	1,9263	0	-2	0,8933	-0,6482
12M	-0,2690	1	7	12M	1,9669	1	11	0,9788	-0,5182

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3519	0	9	-0,3495	-0,1575	0,1100
2Y	-0,3550	1	13	-0,3087	-0,0970	0,1845
3Y	-0,3280	1	15	-0,2581	-0,0270	0,2575
4Y	-0,2820	2	18	-0,2020	0,0450	0,3300
5Y	-0,2290	3	21	-0,1390	0,1170	0,3925
7Y	-0,1040	3	24	-0,0040	0,2540	0,5080
10Y	0,0950	4	27	0,1920	0,4226	0,6345
15Y	0,3660	5	31	0,4244	0,5838	0,7170
20Y	0,5020	6	33	0,5280	0,6299	0,7095
30Y	0,5420	6	34	0,5379	0,5884	0,6227

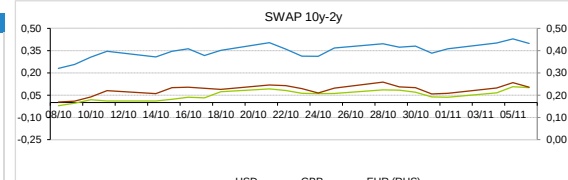
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,00
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7490	0	9	1,5501	1,5670	1,7110
2Y	1,6400	-1	20	1,5350	1,5980	1,7510
3Y	1,5970	-2	24	1,5470	1,6370	1,7760
4Y	1,5790	-6	5	1,5680	1,6665	1,8320
5Y	1,5780	-3	26	1,5960	1,7120	1,8892
7Y	1,6820	8	19	1,6590	1,7930	1,9200
10Y	1,7050	-2	28	1,7610	1,8650	1,9670
15Y	1,5480	-8	9	1,8560	1,9340	2,0050
20Y	1,6040	-7	9	1,9060	1,9600	2,0030
30Y	1,8970	-1	28	1,9220	1,9540	1,9890

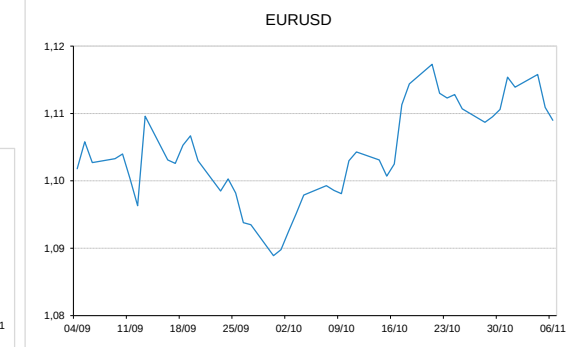
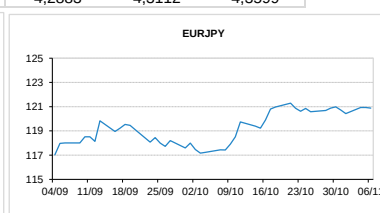


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,28	-0,68	4,54	OT 2Y	-0,551	0,00	7,10
JETFUEL	626,42	-2,47	8,52	OT 5Y	-0,198	-0,02	6,80
DIESEL	588,31	-2,47	6,91	OT 10Y	0,224	-0,03	8,70
COBRE	5.947,00	63,00	297,00	BUND 10Y	-0,769	-0,83	25,10
ZINCO	2.550,50	-53,50	227,00	SCHATZ 2Y	-0,007	0,46	14,40
OURO	1.489,26	5,82	-19,21	T-NOTE 10Y	2,665	-1,84	23,40
TRIGO	519,00	3,75	28,50	T-NOTE 2Y	2,095	-1,53	20,00
LICENÇA C02	24,87	-0,64	1,93	GILT 10Y	0,717	-2,67	27,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,109	-0,17%	0,88%	1,1160	1,1221	1,1344
EUR/GBP	0,86033	0,09%	3,63%	0,8632	0,8661	0,8719
EUR/JPY	120,88	0,04%	-2,85%	120,88	120,88	120,88
EUR/CHF	1,0992	0,00%	-0,63%	1,0983	1,0975	1,0960
EUR/BRL	4,5011	-1,81%	0,08%	4,5362	4,5762	4,6963
EUR/PLN	4,2635	0,04%	1,57%	4,2883	4,3112	4,3599



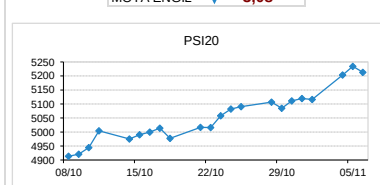
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1090	0,8603	120,88	1,0992	10,6485	7,4715	1,4598	1,6069	4,5011	10,1506
USD	0,9030	-	0,7767	109,005	0,9923	9,6152	6,7468	1,3178	1,4509	4,0526	9,1526

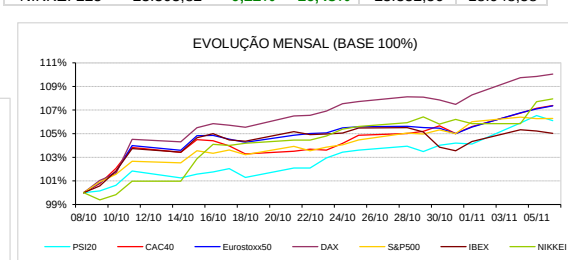
ACCIONISTA

TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,835	-1,52	0,60
BCP	0,207	-1,80	-9,63
CORT. AMORIM	9,930	-1,49	10,33
CTT	2,978	-0,73	1,09
EDP	3,730	0,57	22,34
EDP R	10,240	0,79	31,70
GALP	14,805	0,17	7,32
IBERSOL	7,460	0,00	-5,57
J MARTINS	15,100	0,03	46,03
MOTA ENGIL	2,014	-3,08	25,09
NAVIGATOR	3,472	-0,52	-3,56
NOS	5,235	-1,41	-1,13
NOVABASE	2,680	-0,74	32,67
PHAROL	0,100	-0,40	-38,97
RAMADA	6,260	-0,63	-16,53
REN	12,820	-0,16	-2,14
SEMAPA	0,739	1,23	-12,96
SONAE CAP.	0,934	-0,27	15,25
SONAE SGPS	6,260	-0,63	-16,53

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SEMAPA	1,23
EDP R	0,79
EDP	0,57
GALP	0,17
J MARTINS	0,03
NOS	-1,41
CORT. AMORIM	-1,49
ALTRI	-1,52
BCP	-1,80
MOTA ENGIL	-3,08



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.213,00	-0,41%	10,18%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.859,51	0,22%	23,86%	5.876,27	4.555,99
ESTX 50 PR	3.685,31	0,24%	22,79%	3.692,20	2.908,70
XTRA DAX	13.172,76	0,18%	24,75%	13.187,66	10.279,20
S&P 500	3.075,10	0,01%	22,66%	3.085,20	2.346,58
IBEX 35	9.389,80	-0,19%	9,95%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	23.303,82	0,22%	16,43%	23.352,56	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.