

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

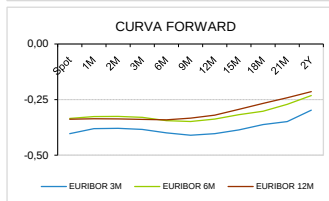
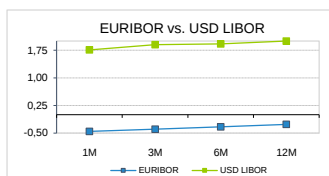
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

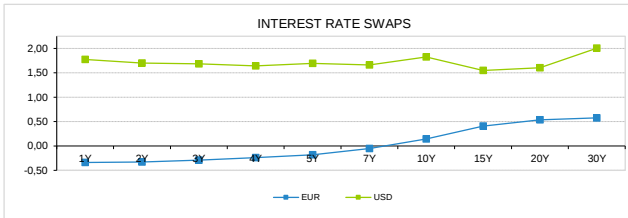
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4530	1	2	1M	1,7590	0	-18	0,7161	-0,7360
3M	-0,3940	0	2	3M	1,9006	0	-11	0,7899	-0,7092
6M	-0,3310	-1	3	6M	1,9230	0	-4	0,8714	-0,6476
12M	-0,2630	0	4	12M	1,9998	2	11	0,9575	-0,5298

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3390	1	6	-0,3196	-0,0789	0,2040
2Y	-0,3280	1	15	-0,2693	-0,0100	0,2829
3Y	-0,2900	2	19	-0,2046	0,0624	0,3540
4Y	-0,2400	3	22	-0,1392	0,1367	0,4235
5Y	-0,1820	3	24	-0,0702	0,2090	0,4905
7Y	-0,0540	4	28	0,0723	0,3467	0,5994
10Y	0,1440	5	30	0,2706	0,5102	0,7205
15Y	0,4060	5	32	0,4986	0,6628	0,8010
20Y	0,5370	5	33	0,6053	0,7128	0,7919
30Y	0,5760	5	33	0,6162	0,6708	0,7054

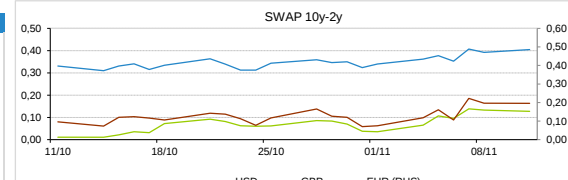
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,00
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7750	3	11	1,6452	1,7232	1,8066
2Y	1,7000	5	24	1,6586	1,7422	1,8788
3Y	1,6830	6	30	1,6797	1,7635	1,9362
4Y	1,6430	6	11	1,7020	1,8176	1,9603
5Y	1,6950	7	36	1,7287	1,8585	1,9884
7Y	1,6610	-3	31	1,7988	1,9163	2,0424
10Y	1,8240	8	39	1,8864	1,9918	2,0883
15Y	1,5480	-8	9	1,9797	2,0569	2,1255
20Y	1,6040	-7	9	2,0265	2,0734	2,1232
30Y	2,0040	8	38	2,0433	2,0726	2,0941

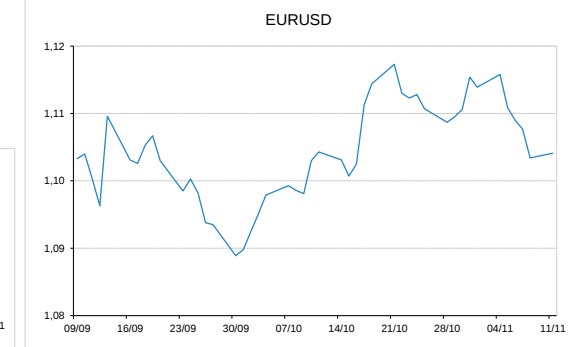
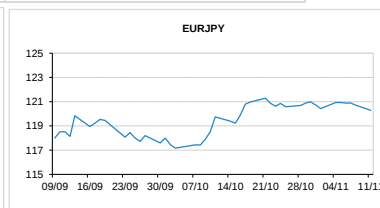
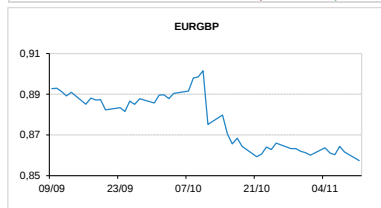


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,44	-0,07	2,32	OT 2Y	-0,491	0,03	9,30
JETFUEL	619,45	-0,79	5,34	OT 5Y	-0,107	0,03	11,70
DIESEL	583,69	0,45	2,83	OT 10Y	0,354	0,03	15,30
COBRE	5.923,00	-50,00	248,50	BUND 10Y	-0,688	1,47	24,30
ZINCO	2.519,50	-8,50	206,50	SCHATZ 2Y	0,016	0,23	12,10
OURO	1.455,07	-6,74	-30,00	T-NOTE 10Y	2,742	0,62	23,30
TRIGO	509,25	-1,00	1,25	T-NOTE 2Y	2,156	1,34	18,90
LICENÇA C02	25,00	0,16	0,56	GILT 10Y	0,795	1,97	25,20



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1041	0,06%	-0,02%	1,1111	1,1173	1,1299
EUR/GBP	0,85743	0,48%	2,07%	0,8603	0,8630	0,8688
EUR/JPY	120,29	0,36%	-0,45%	120,29	120,29	120,29
EUR/CHF	1,0973	0,19%	0,32%	1,0964	1,0955	1,0938
EUR/BRL	4,5764	0,36%	-0,88%	4,6230	4,6622	4,7681
EUR/PLN	4,2715	-0,17%	0,76%	4,2964	4,3196	4,3679



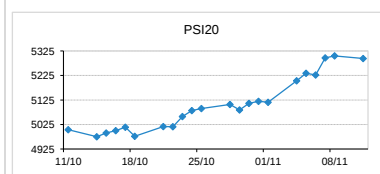
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1041	0,8574	120,29	1,0973	10,7142	7,4722	1,4594	1,61146	4,5764	10,0892
USD	0,9062	-	0,7769	109,095	0,9946	9,7126	6,7715	1,3216	1,4602	4,1513	9,1446

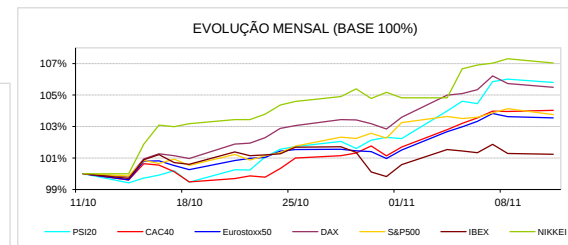
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,045	1,09	4,22
BCP	0,214	-1,02	-6,62
CORT. AMORIM	9,930	0,10	10,33
CTT	3,044	-3,43	3,33
EDP	3,690	0,14	21,02
EDP R	10,220	-0,58	31,45
GALP	14,900	-0,27	8,01
IBERSOL	7,600	1,33	-3,80
J MARTINS	15,330	-0,55	48,26
MOTA ENGIL	2,058	0,39	27,83
NAVIGATOR	3,586	0,73	-0,39
NOS	5,330	0,09	0,66
NOVABASE	2,750	-1,43	36,14
PHAROL	0,109	-3,72	-33,33
RAMADA	6,260	-1,57	-16,53
REN	13,700	0,29	4,58
SEMAPA	0,787	2,21	-7,30
SONAE CAP.	0,936	0,75	15,56
SONAE SGPS	6,260	-1,57	-16,53

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SEMAPA	2,21
IBERSOL	1,33
ALTRI	1,09
SONAE CAP.	0,75
NAVIGATOR	0,73
NOVABASE	-1,43
RAMADA	-1,57
RAMADA	-1,57
CTT	-3,43
PHAROL	-3,72



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.294,47	-0,19%	11,90%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.893,82	0,07%	24,59%	5.906,33	4.555,99
ESTX 50 PR	3.696,82	-0,08%	23,17%	3.708,65	2.908,70
XTRA DAX	13.198,37	-0,23%	25,00%	13.300,77	10.279,20
S&P 500	3.082,21	-0,35%	22,95%	3.097,77	2.346,58
IBEX 35	9.388,50	-0,06%	9,94%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	23.331,84	-0,26%	16,57%	23.591,09	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.