

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

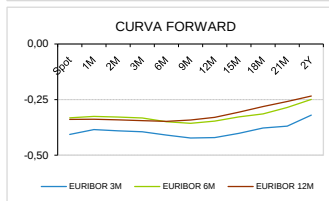
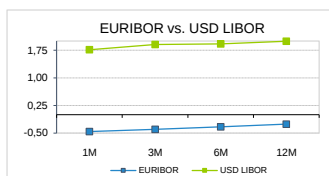
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

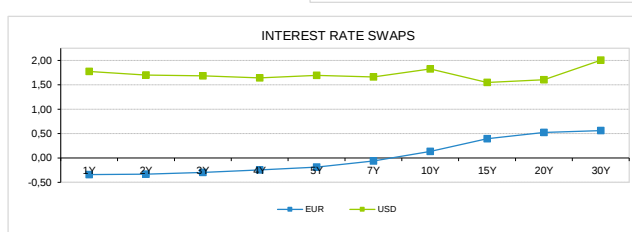
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4570	0	2	1M	1,7633	0	-15	0,7155	-0,7372
3M	-0,3980	0	2	3M	1,9046	0	-10	0,7884	-0,7084
6M	-0,3280	0	3	6M	1,9230	0	-5	0,8689	-0,6478
12M	-0,2550	1	5	12M	1,9941	-1	4	0,9580	-0,5248

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3407	0	5	-0,3300	-0,1018	0,1865
2Y	-0,3320	0	10	-0,2818	-0,0307	0,2630
3Y	-0,2970	-1	12	-0,2209	0,0431	0,3350
4Y	-0,2460	-1	15	-0,1553	0,1161	0,4039
5Y	-0,1880	-1	16	-0,0868	0,1884	0,4730
7Y	-0,0620	-1	19	0,0548	0,3242	0,5783
10Y	0,1330	-1	21	0,2521	0,4893	0,7001
15Y	0,3930	-1	23	0,4808	0,6433	0,7815
20Y	0,5230	-1	24	0,5869	0,6939	0,7737
30Y	0,5610	-2	25	0,5988	0,6521	0,6868

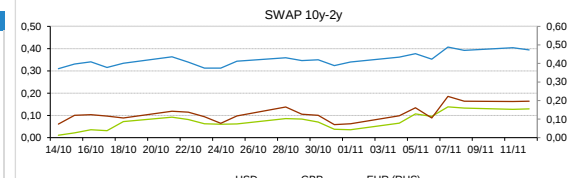
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,00
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7750	3	11	1,6105	1,6710	1,8165
2Y	1,7000	5	24	1,6220	1,7060	1,8380
3Y	1,6830	6	30	1,6410	1,7345	1,8780
4Y	1,6430	6	11	1,6650	1,7690	1,9130
5Y	1,6950	7	36	1,6880	1,8040	1,9730
7Y	1,6610	-3	31	1,7490	1,8780	1,9965
10Y	1,8240	8	39	1,8637	1,9475	2,0410
15Y	1,5480	-8	9	1,9430	2,0200	2,0780
20Y	1,6040	-7	9	1,9875	2,0385	2,0790
30Y	2,0040	8	38	2,0204	2,0508	2,0525

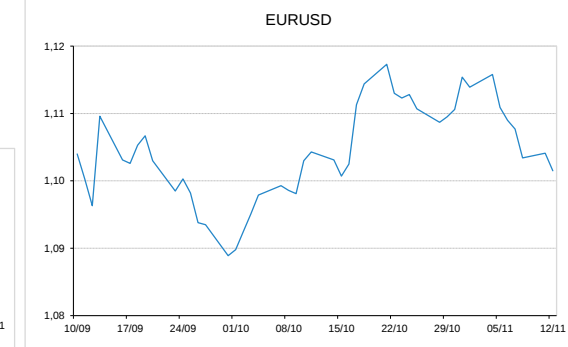
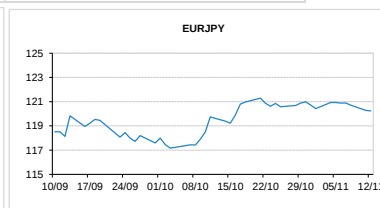
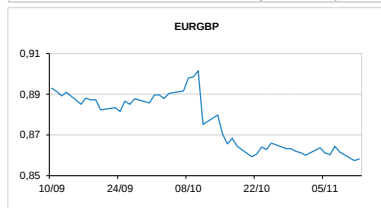


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,16	-0,02	2,04	OT 2Y	-0,489	0,00	9,00
JETFUEL	615,21	-5,68	-17,68	OT 5Y	-0,103	0,01	12,10
DIESEL	578,25	-6,23	-21,75	OT 10Y	0,362	0,01	15,90
COBRE	5.880,00	-45,50	82,50	BUND 10Y	-0,704	-1,05	18,60
ZINCO	2.538,00	18,50	88,50	SCHATZ 2Y	0,005	-1,15	10,80
OURO	1.452,80	-3,11	-36,30	T-NOTE 10Y	2,736	0,00	14,40
TRIGO	513,50	7,75	5,50	T-NOTE 2Y	2,143	-1,15	9,20
LICENÇA C02	24,12	-0,81	-0,32	GILT 10Y	0,786	0,18	8,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1015	-0,24%	-0,15%	1,1085	1,1147	1,1273
EUR/GBP	0,8582	-0,09%	2,52%	0,8610	0,8638	0,8696
EUR/JPY	120,24	0,04%	-0,70%	120,24	120,24	120,24
EUR/CHF	1,0943	0,16%	0,50%	1,0934	1,0925	1,0909
EUR/BRL	4,5956	-0,43%	-0,99%	4,6423	4,6819	4,7863
EUR/PLN	4,2800	-0,18%	0,39%	4,3050	4,3284	4,3771



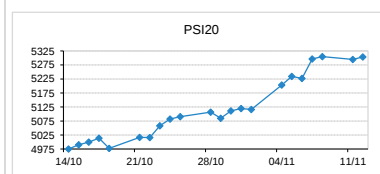
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1015	0,8582	120,24	1,0943	10,6923	7,4723	1,4577	1,6089	4,5956	10,0766
USD	0,9081	-	0,7788	109,145	0,9943	9,7086	6,7849	1,3229	1,4615	4,1715	9,1483

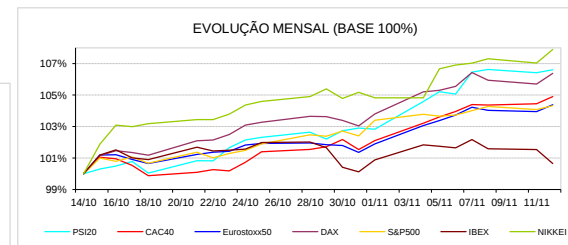
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,005	-0,66	3,53
BCP	0,214	-0,14	-6,75
CORT. AMORIM	9,960	0,30	10,67
CTT	3,120	2,50	5,91
EDP	3,686	-0,11	20,89
EDP R	10,180	-0,39	30,93
GALP	15,050	1,01	9,10
IBERSOL	7,500	-1,32	-5,06
J MARTINS	15,420	0,59	49,13
MOTA ENGIL	2,084	1,26	29,44
NAVIGATOR	3,542	-1,23	-1,61
NOS	5,320	-0,19	0,47
NOVABASE	2,760	0,36	36,63
PHAROL	0,106	-2,76	-35,17
RAMADA	6,200	-0,96	-17,33
REN	13,980	2,04	6,72
SEMAPA	0,813	3,30	-4,24
SONAE CAP.	0,940	0,43	16,05
SONAE SGPS	6,200	-0,96	-17,33

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SEMAPA	3,30
CTT	2,50
REN	2,04
MOTA ENGIL	1,26
GALP	1,01
RAMADA	-0,96
RAMADA	-0,96
NAVIGATOR	-1,23
IBERSOL	-1,32
PHAROL	-2,76



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.303,82	0,18%	12,10%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.919,75	0,44%	25,14%	5.931,19	4.555,99
ESTX 50 PR	3.712,20	0,42%	23,68%	3.719,40	2.908,70
XTRA DAX	13.283,51	0,65%	25,80%	13.308,26	10.279,20
S&P 500	3.094,21	0,24%	23,44%	3.102,61	2.346,58
IBEX 35	9.306,70	-0,87%	8,98%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	23.520,01	0,81%	17,51%	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.