

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

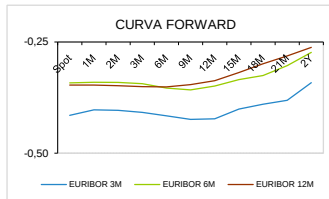
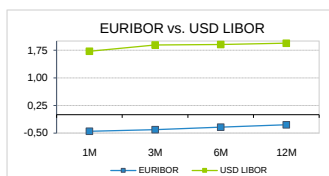
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

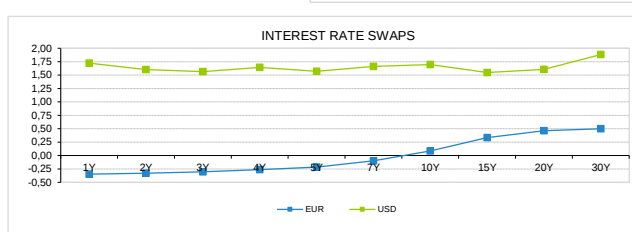
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4500	1	-1	1M	1,7216	0	-13	0,7133	-0,7464
3M	-0,4060	0	0	3M	1,8946	0	-6	0,7893	-0,7100
6M	-0,3380	0	1	6M	1,9070	-1	-4	0,8579	-0,6480
12M	-0,2730	0	3	12M	1,9416	-1	-5	0,9653	-0,5266

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3468	-1	2	-0,3373	-0,1530	0,0880
2Y	-0,3310	0	2	-0,2993	-0,0922	0,1570
3Y	-0,3050	0	5	-0,2510	-0,0320	0,2280
4Y	-0,2640	0	6	-0,1961	0,0320	0,2960
5Y	-0,2150	-1	6	-0,1390	0,1000	0,3590
7Y	-0,1000	-1	7	-0,0140	0,2280	0,4660
10Y	0,0840	-1	6	0,1703	0,3886	0,5890
15Y	0,3350	-1	6	0,3899	0,5414	0,6740
20Y	0,4620	-1	6	0,4952	0,5928	0,6685
30Y	0,4990	-1	6	0,5042	0,5505	0,5808

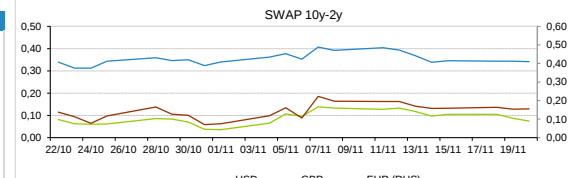
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,00
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7210	-2	-2	1,4360	1,4710	1,6342
2Y	1,6010	-3	-2	1,4110	1,5130	1,6245
3Y	1,5650	-3	0	1,4295	1,5641	1,6890
4Y	1,6430	6	11	1,4585	1,5820	1,7240
5Y	1,5710	-3	2	1,4795	1,6160	1,7823
7Y	1,6610	-3	31	1,5630	1,6515	1,7820
10Y	1,6960	-3	3	1,6762	1,7335	1,8580
15Y	1,5480	-8	9	1,7706	1,7970	1,8970
20Y	1,6040	-7	9	1,8197	1,8290	1,9184
30Y	1,8830	-3	2	1,7845	1,8140	1,8430

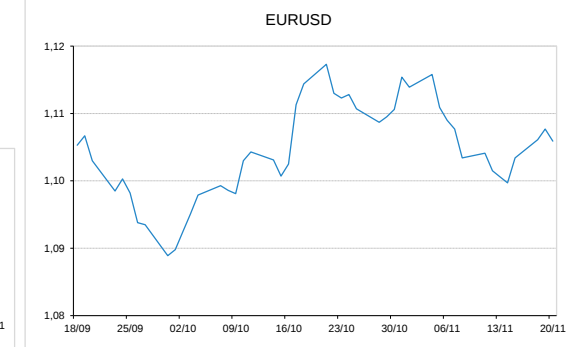
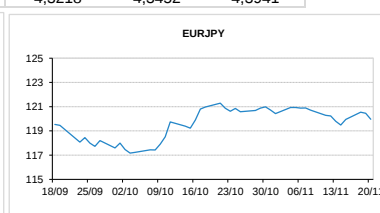


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,49	1,58	3,40	OT 2Y	-0,473	-0,01	8,60
JETFUEL	605,81	-5,64	-23,20	OT 5Y	-0,081	0,01	11,10
DIESEL	571,75	-6,05	-22,50	OT 10Y	0,385	0,01	14,80
COBRE	5.880,00	45,00	69,00	BUND 10Y	-0,799	-1,18	-1,30
ZINCO	2.363,50	4,00	-111,00	SCHATZ 2Y	-0,009	-0,23	2,30
OURO	1.467,93	-6,67	-24,08	T-NOTE 10Y	2,616	-1,68	0,20
TRIGO	515,50	0,25	-21,50	T-NOTE 2Y	2,072	-0,76	2,70
LICENÇA C02	24,03	0,59	-1,85	GILT 10Y	0,710	-0,18	-2,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1059	-0,16%	-1,02%	1,1130	1,1189	1,1310
EUR/GBP	0,85715	-0,17%	0,25%	0,8600	0,8627	0,8684
EUR/JPY	119,96	0,42%	1,11%	119,96	119,96	119,96
EUR/CHF	1,0979	-0,02%	0,15%	1,0970	1,0961	1,0943
EUR/BRL	4,6435	0,21%	-0,83%	4,6959	4,7340	4,8498
EUR/PLN	4,2954	-0,22%	-0,43%	4,3218	4,3452	4,3941



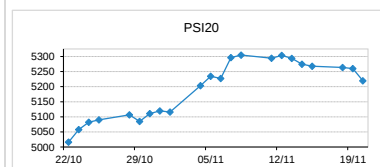
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1059	0,8572	119,96	1,0979	10,6639	7,4732	1,4724	1,62779	4,6435	10,1152
USD	0,9036	-	0,7746	108,635	0,9926	9,6272	6,7531	1,3294	1,4696	4,1964	9,1336

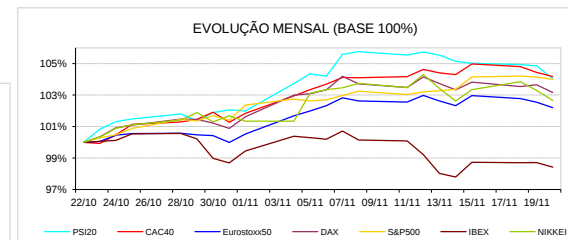
ACCIONISTA

TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,815	-1,19	0,26
BCP	0,205	-1,21	-10,81
CORT. AMORIM	10,600	1,73	17,78
CTT	3,142	-0,76	6,65
EDP	3,715	-0,32	21,84
EDP R	10,200	0,39	31,19
GALP	15,120	-0,85	9,60
IBERSOL	7,340	-0,27	-7,09
J MARTINS	14,685	-1,28	42,02
MOTA ENGIL	2,072	-1,80	28,70
NAVIGATOR	3,540	-1,50	-1,67
NOS	5,070	-0,59	-4,25
NOVABASE	2,870	0,00	42,08
PHAROL	0,110	-0,54	-32,72
RAMADA	6,120	-0,97	-18,40
REN	14,040	-0,43	7,18
SEMAPA	0,811	-0,25	-4,48
SONAE CAP.	0,912	-2,04	12,59
SONAE SGPS	6,120	-0,97	-18,40

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	1,73
EDP R	0,39
BCP	-1,21
J MARTINS	-1,28
NAVIGATOR	-1,50
MOTA ENGIL	-1,80
SONAE CAP.	-2,04



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.219,58	-0,77%	10,32%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.894,03	-0,25%	24,59%	5.966,79	4.555,99
ESTX 50 PR	3.684,03	-0,34%	22,74%	3.733,45	2.908,70
XTRA DAX	13.158,14	-0,48%	24,62%	13.374,27	10.279,20
S&P 500	3.115,84	-0,14%	24,29%	3.127,64	2.346,58
IBEX 35	9.232,30	-0,29%	8,11%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	23.148,57	-0,62%	15,66%	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.