

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

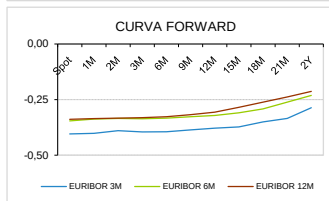
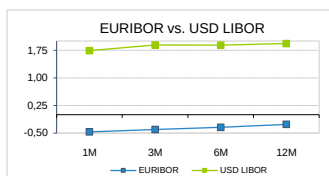
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

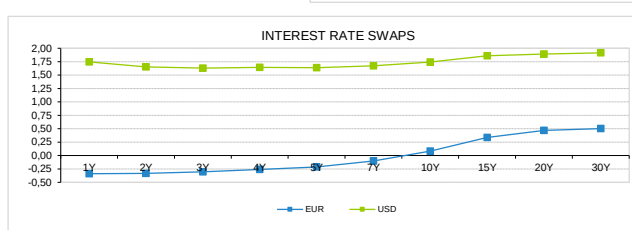
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4670	0	0	1M	1,7398	0	-2	0,7008	-0,8218
3M	-0,4000	-1	0	3M	1,8936	1	-2	0,7786	-0,7224
6M	-0,3400	0	0	6M	1,8864	0	-4	0,8510	-0,6542
12M	-0,2630	0	0	12M	1,9329	-1	-7	0,9531	-0,5238

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3388	0	1	-0,3073	-0,1130	0,1218
2Y	-0,3330	0	0	-0,2612	-0,0585	0,1856
3Y	-0,3030	0	-1	-0,2113	0,0020	0,2521
4Y	-0,2610	0	-2	-0,1581	0,0634	0,3131
5Y	-0,2130	0	-4	-0,1022	0,1265	0,3710
7Y	-0,1020	-1	-6	0,0174	0,2515	0,4883
10Y	0,0810	-1	-8	0,1947	0,4103	0,6077
15Y	0,3360	-1	-9	0,4134	0,5630	0,6981
20Y	0,4670	-1	-10	0,5169	0,6117	0,6840
30Y	0,5020	-1	-10	0,5203	0,5669	0,5978

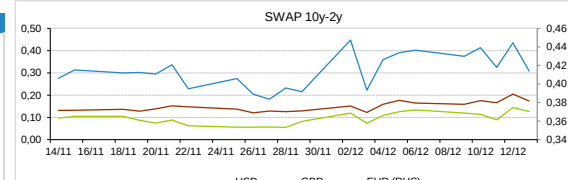
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7460	0	-3	1,5945	1,6050	1,7450
2Y	1,6530	0	-5	1,5230	1,6657	1,7645
3Y	1,6300	-1	-5	1,5490	1,6790	1,7945
4Y	1,6430	6	11	1,5971	1,7065	1,8549
5Y	1,6380	-1	-6	1,6145	1,7360	1,8919
7Y	1,6720	3	1	1,6710	1,8000	1,9170
10Y	1,7430	-2	-8	1,7680	1,8745	1,9862
15Y	1,8610	2	31	1,8775	1,9390	2,0030
20Y	1,8930	29	29	1,9065	1,9605	2,0050
30Y	1,9140	-2	-9	1,9378	1,9673	1,9851

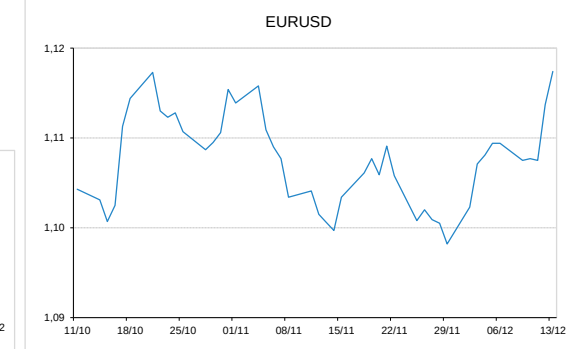
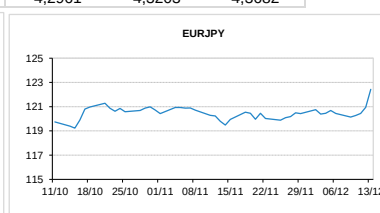


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,73	0,53	3,19	OT 2Y	-0,543	-0,01	-7,60
JETFUEL	625,50	7,09	10,29	OT 5Y	-0,134	-0,03	-3,30
DIESEL	592,25	8,04	14,00	OT 10Y	0,368	-0,03	0,30
COBRE	6.161,50	0,00	287,00	BUND 10Y	-0,875	-2,96	0,50
ZINCO	2.262,00	42,00	-234,50	SCHATZ 2Y	0,021	0,23	1,90
OURO	1.475,63	7,76	14,56	T-NOTE 10Y	2,677	-5,86	-1,10
TRIGO	528,25	-2,00	14,50	T-NOTE 2Y	2,036	-5,92	1,00
LICENÇA C02	24,37	-0,70	-0,02	GILT 10Y	0,710	-3,64	3,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1174	0,33%	1,53%	1,1243	1,1306	1,1427
EUR/GBP	0,83508	1,26%	2,70%	0,8378	0,8406	0,8462
EUR/JPY	122,43	-1,21%	-2,16%	122,43	122,43	122,43
EUR/CHF	1,0937	0,22%	-0,44%	1,0929	1,0921	1,0903
EUR/BRL	4,5708	-0,38%	0,61%	4,6178	4,6614	4,7795
EUR/PLN	4,2713	0,33%	0,41%	4,2961	4,3203	4,3682



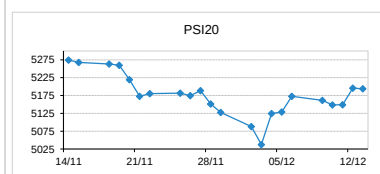
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1174	0,8351	122,43	1,0937	10,4611	7,4731	1,4679	1,6198	4,5708	10,0770
USD	0,8981	-	0,7496	109,285	0,9829	9,3907	6,7118	1,3197	1,4549	4,1059	9,0493

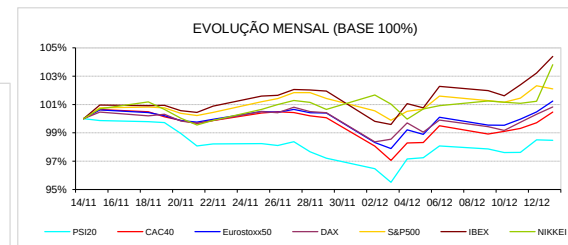
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,790	-0,94	-0,17
BCP	0,202	1,66	-12,16
CORT. AMORIM	11,340	0,18	26,00
CTT	3,262	-0,43	10,73
EDP	3,741	1,00	22,70
EDP R	10,000	-0,99	28,62
GALP	14,625	1,21	6,02
IBERSOL	7,760	-0,51	-1,77
J MARTINS	14,855	0,20	43,67
MOTA ENGIL	1,825	-0,60	13,35
NAVIGATOR	3,620	-0,06	0,56
NOS	4,890	-3,36	-7,65
NOVABASE	2,750	-0,36	43,07
PHAROL	0,103	0,00	-37,01
RAMADA	5,960	0,00	-20,53
REN	14,120	0,57	7,79
SEMAPA	0,778	-0,64	-8,36
SONAE CAP.	0,937	-0,32	15,62
SONAE SGPS	5,960	0,00	-20,53

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	1,66
GALP	1,21
EDP	1,00
REN	0,57
J MARTINS	0,20
MOTA ENGIL	-0,60
SEMAPA	-0,64
ALTRI	-0,94
EDP R	-0,99
NOS	-3,36



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.193,90	-0,03%	9,77%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.928,41	0,75%	25,32%	5.972,17	4.555,99
ESTX 50 PR	3.734,60	0,76%	24,43%	3.765,70	2.908,70
XTRA DAX	13.287,89	0,51%	25,86%	13.423,41	10.279,20
S&P 500	3.161,48	-0,21%	26,13%	3.182,68	2.346,58
IBEX 35	9.576,20	1,14%	12,13%	9.650,90	8.286,20
NIKKEI 225	24.023,10	2,55%	20,03%	24.050,04	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.