

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

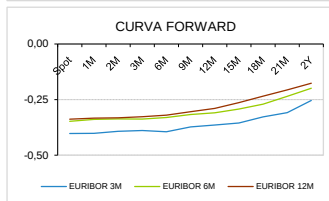
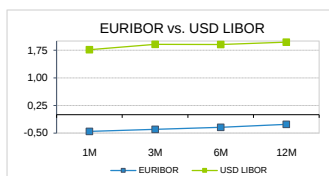
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

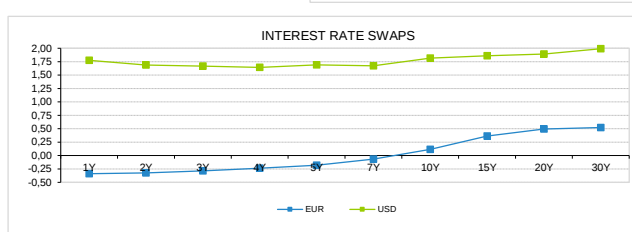
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4530	1	0	1M	1,7646	0	4	0,7036	-0,7886
3M	-0,3980	1	1	3M	1,9080	1	1	0,7898	-0,7062
6M	-0,3420	1	-1	6M	1,9049	0	-1	0,8561	-0,6350
12M	-0,2620	1	1	12M	1,9696	0	2	0,9568	-0,5098

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3388	0	0	-0,2901	-0,0576	0,2083
2Y	-0,3240	0	1	-0,2356	0,0114	0,2723
3Y	-0,2860	0	2	-0,1741	0,0705	0,3405
4Y	-0,2360	0	3	-0,1108	0,1416	0,3999
5Y	-0,1820	0	3	-0,0470	0,2084	0,4682
7Y	-0,0680	0	2	0,0820	0,3366	0,5781
10Y	0,1140	0	2	0,2702	0,4940	0,6975
15Y	0,3630	0	2	0,4871	0,6440	0,7820
20Y	0,4930	0	2	0,5914	0,6902	0,7677
30Y	0,5220	0	2	0,5926	0,6430	0,6758

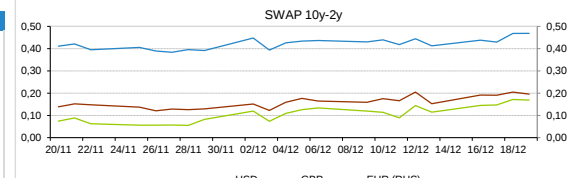
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7750	3	3	1,5861	1,7050	1,8560
2Y	1,6860	0	5	1,5890	1,7430	1,8910
3Y	1,6660	5	7	1,6270	1,7946	1,9392
4Y	1,6430	6	11	1,6645	1,8160	1,9729
5Y	1,6900	5	9	1,7000	1,8651	2,0079
7Y	1,6720	3	1	1,7870	1,9160	2,0390
10Y	1,8150	4	9	1,8710	2,0051	2,0986
15Y	1,8610	2	31	1,9809	2,0510	2,1160
20Y	1,8930	29	29	2,0140	2,0730	2,1329
30Y	1,9910	4	8	2,0260	2,0620	2,0840

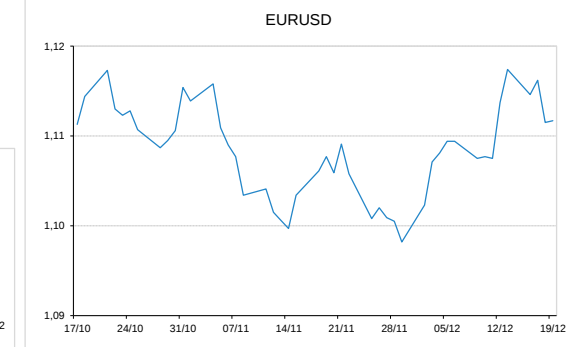
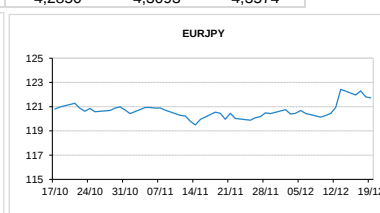


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	66,44	0,27	6,42	OT 2Y	-0,551	-0,01	-9,20
JETFUEL	652,71	4,92	46,90	OT 5Y	-0,115	0,02	-2,50
DIESEL	618,68	3,93	46,93	OT 10Y	0,410	0,02	3,70
COBRE	6.187,00	-25,50	344,50	BUND 10Y	-0,821	0,55	10,10
ZINCO	2.308,00	19,25	-43,50	SCHATZ 2Y	0,016	0,23	2,30
OURO	1.479,93	0,03	8,44	T-NOTE 10Y	2,737	-2,01	10,80
TRIGO	547,75	-0,50	32,50	T-NOTE 2Y	2,055	-2,87	7,10
LICENÇA C02	26,85	0,27	3,27	GILT 10Y	0,708	0,09	5,20



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1117	0,02%	0,36%	1,1185	1,1249	1,1373
EUR/GBP	0,85073	-0,02%	0,59%	0,8535	0,8563	0,8618
EUR/JPY	121,73	0,07%	-1,04%	121,73	121,73	121,73
EUR/CHF	1,0872	0,02%	0,89%	1,0864	1,0856	1,0840
EUR/BRL	4,5118	0,23%	3,10%	4,5727	4,6184	4,7365
EUR/PLN	4,2608	0,00%	0,82%	4,2850	4,3093	4,3574



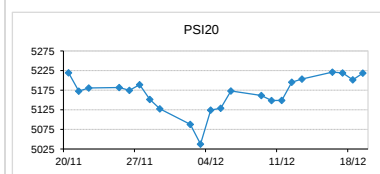
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1117	0,8507	121,73	1,0872	10,4835	7,4731	1,4598	1,61647	4,5118	9,9798
USD	0,8996	-	0,7675	109,295	0,9784	9,4314	6,7226	1,3130	1,4538	4,0671	8,9745

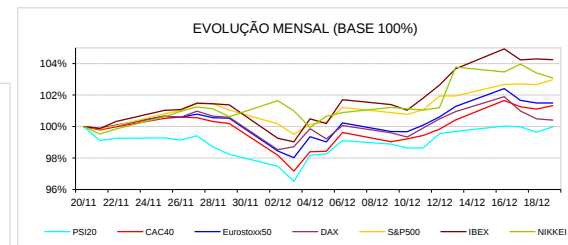
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,805	0,09	0,09
BCP	0,206	1,78	-10,41
CORT. AMORIM	11,400	-0,52	27,64
CTT	3,190	0,06	8,28
EDP	3,836	1,62	25,81
EDP R	10,040	-0,40	29,13
GALP	15,045	0,60	9,06
IBERSOL	7,900	-0,25	0,00
J MARTINS	14,580	0,69	41,01
MOTA ENGIL	1,906	-1,50	18,39
NAVIGATOR	3,546	-0,78	-1,50
NOS	4,864	-1,06	-8,14
NOVABASE	2,550	-1,92	32,66
PHAROL	0,101	-0,59	-38,36
RAMADA	5,820	-2,68	-22,40
REN	13,700	-0,72	4,58
SEMAPA	0,770	0,00	-9,31
SONAE CAP.	0,927	-0,22	14,38
SONAE SGPS	5,820	-2,68	-22,40

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	1,78
EDP	1,62
J MARTINS	0,69
GALP	0,60
ALTRI	0,09
NOS	-1,06
MOTA ENGIL	-1,50
NOVABASE	-1,92
RAMADA	-2,68
RAMADA	-2,68



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.218,51	0,33%	10,29%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.972,28	0,21%	26,25%	6.003,38	4.555,99
ESTX 50 PR	3.739,17	0,00%	24,58%	3.778,47	2.908,70
XTRA DAX	13.211,96	-0,08%	25,13%	13.425,85	10.279,20
S&P 500	3.200,87	0,31%	27,69%	3.203,36	2.346,58
IBEX 35	9.617,20	-0,05%	12,61%	9.692,40	8.286,20
NIKKEI 225	23.864,85	-0,29%	19,24%	24.091,12	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.