

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

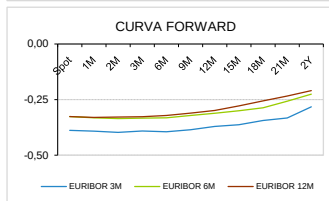
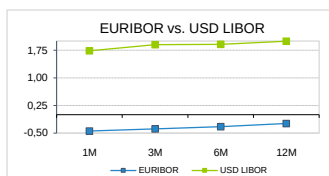
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

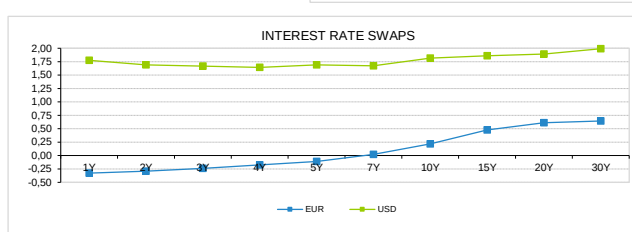
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4430	-1	1	1M	1,7344	-3	4	0,7021	-0,7726
3M	-0,3840	-1	1	3M	1,9003	-1	0	0,7963	-0,6866
6M	-0,3230	0	1	6M	1,9095	0	0	0,8724	-0,6186
12M	-0,2380	1	3	12M	1,9949	0	3	0,9779	-0,4758

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3280	-1	2	-0,2992	-0,0941	0,1496
2Y	-0,2910	1	3	-0,2564	-0,0363	0,2195
3Y	-0,2400	1	4	-0,2022	0,0258	0,2910
4Y	-0,1750	2	6	-0,1466	0,0921	0,3596
5Y	-0,1100	2	7	-0,0873	0,1602	0,4210
7Y	0,0200	2	9	0,0410	0,2897	0,5300
10Y	0,2160	3	11	0,2267	0,4496	0,6519
15Y	0,4770	3	12	0,4472	0,6015	0,7365
20Y	0,6100	3	13	0,5520	0,6503	0,7274
30Y	0,6440	4	13	0,5572	0,6058	0,6369

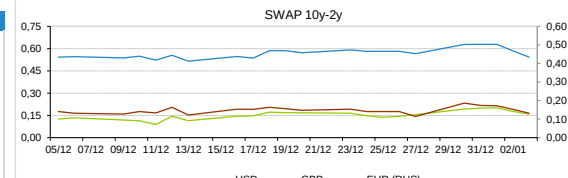
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7750	3	3	1,5463	1,6025	1,7800
2Y	1,6890	-1	7	1,5085	1,6495	1,8095
3Y	1,6660	5	7	1,5430	1,6810	1,9336
4Y	1,6430	6	11	1,5981	1,7285	1,8900
5Y	1,6900	5	9	1,6145	1,7899	1,9423
7Y	1,6720	3	1	1,6950	1,8420	1,9550
10Y	1,8150	4	9	1,7945	1,9060	1,9990
15Y	1,8610	2	31	1,8940	1,9680	2,0375
20Y	1,8930	29	29	1,9415	1,9895	2,0315
30Y	1,9910	4	8	1,9390	1,9780	1,9990

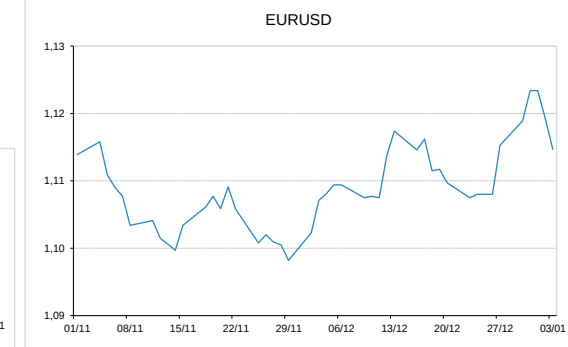
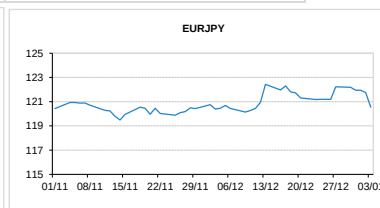


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	68,06	1,81	7,95	OT 2Y	-0,537	0,00	3,60
JETFUEL	667,59	14,47	59,62	OT 5Y	-0,168	-0,04	-4,50
DIESEL	630,36	12,45	56,32	OT 10Y	0,359	-0,06	-2,00
COBRE	6.207,00	14,00	305,00	BUND 10Y	-0,872	-6,00	3,30
ZINCO	2.323,75	42,75	70,50	SCHATZ 2Y	0,009	-1,84	0,90
OURO	1.547,98	22,62	68,97	T-NOTE 10Y	2,654	-5,85	2,00
TRIGO	554,25	-6,00	29,00	T-NOTE 2Y	1,986	-5,15	-1,60
LICENÇA C02	24,98	0,59	0,83	GILT 10Y	0,660	-5,04	0,50



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1147	-0,41%	0,69%	1,1210	1,1273	1,1398
EUR/GBP	0,85115	-0,34%	0,10%	0,8538	0,8566	0,8620
EUR/JPY	120,54	1,00%	-0,12%	120,54	120,54	120,54
EUR/CHF	1,0844	0,20%	0,85%	1,0836	1,0828	1,0812
EUR/BRL	4,5125	-0,39%	3,26%	4,5780	4,6239	4,7382
EUR/PLN	4,2430	0,02%	0,91%	4,2659	4,2895	4,3379



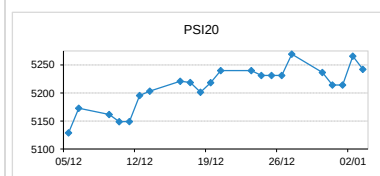
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1147	0,8512	120,54	1,0844	10,4890	7,4733	1,4508	1,60461	4,5125	9,8547
USD	0,8956	-	0,7648	108,025	0,9706	9,3886	6,6933	1,2982	1,4373	4,0437	8,8183

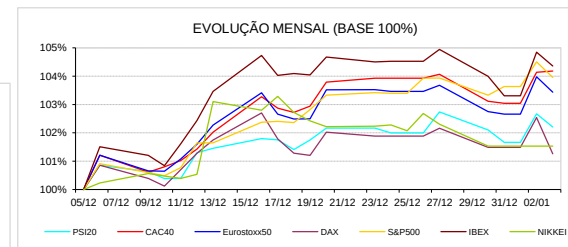
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,740	-0,09	1,06
BCP	0,205	-2,89	0,94
CORT. AMORIM	11,340	-0,18	0,35
CTT	3,154	-1,87	-1,13
EDP	3,857	0,29	-0,18
EDP R	10,260	-1,16	-2,29
GALP	15,340	2,40	2,95
IBERSOL	8,100	1,25	1,25
J MARTINS	14,735	-1,21	0,48
MOTA ENGIL	1,865	-1,84	-0,27
NAVIGATOR	3,608	-0,77	0,56
NOS	4,876	0,41	1,58
NOVABASE	2,640	0,00	2,33
PHAROL	0,102	-1,17	2,21
RAMADA	5,840	0,00	0,00
REN	13,820	-0,29	0,73
SEMAPA	0,768	-0,26	1,99
SONAE CAP.	0,896	-2,13	-1,54
SONAE SGPS	5,840	0,00	0,00

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
GALP	2,40
IBERSOL	1,25
NOS	0,41
EDP	0,29
J MARTINS	-1,21
MOTA ENGIL	-1,84
CTT	-1,87
SONAE CAP.	-2,13
BCP	-2,89



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.242,13	-0,45%	0,54%	5.429,32	4.699,20
CAC40	6.044,16	0,04%	1,11%	6.065,00	4.607,68
ESTX 50 PR	3.773,37	-0,52%	0,75%	3.801,13	2.950,82
XTRA DAX	13.219,14	-1,25%	-0,23%	13.425,85	10.400,11
S&P 500	3.240,76	-0,53%	0,31%	3.258,14	2.443,96
IBEX 35	9.646,60	-0,46%	1,02%	9.705,40	8.409,20
NIKKEI 225	23.656,62	-0,76%	0,00%	24.091,12	19.241,37



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.