

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

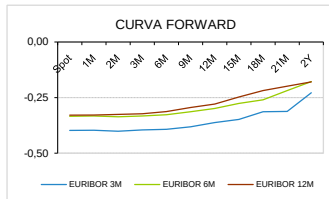
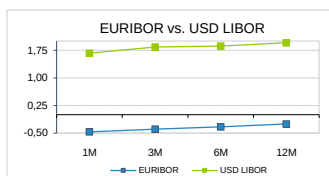
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

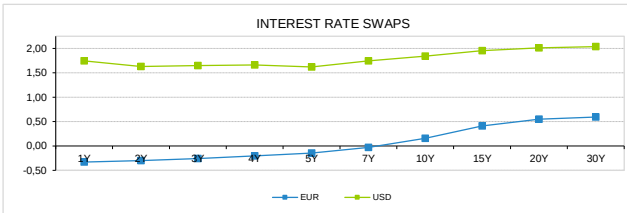
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,4660	-1	0	1M	1,6690	0	-7	0,6595
3M	-0,3930	0	0	3M	1,8361	-1	-6	0,7250
6M	-0,3300	0	1	6M	1,8650	0	-4	0,7656
12M	-0,2510	0	1	12M	1,9528	-1	-1	0,8263

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3300	0	1	-0,2818	-0,0631	0,1796
2Y	-0,3010	-1	2	-0,2291	-0,0021	0,2445
3Y	-0,2580	-1	2	-0,1738	0,0586	0,3150
4Y	-0,2040	-2	2	-0,1155	0,1215	0,3845
5Y	-0,1470	-2	2	-0,0563	0,1886	0,4440
7Y	-0,0290	-2	2	0,0694	0,3170	0,5555
10Y	0,1570	-3	2	0,2553	0,4820	0,6838
15Y	0,4120	-4	2	0,4865	0,6480	0,7760
20Y	0,5500	-4	2	0,5928	0,6963	0,7740
30Y	0,5930	-4	3	0,6075	0,6591	0,6935

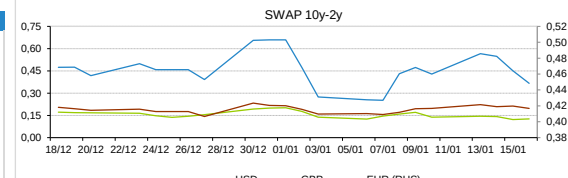
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7450	3	1	1,5650	1,6269	1,7729
2Y	1,6300	-1	-1	1,5704	1,6641	1,7930
3Y	1,6480	7	4	1,5710	1,6810	1,8270
4Y	1,6600	8	2	1,6149	1,7190	1,8600
5Y	1,6200	-3	-2	1,6440	1,7720	1,9161
7Y	1,7440	9	7	1,7104	1,8403	1,9681
10Y	1,8400	9	9	1,8068	1,9185	2,0159
15Y	1,9530	9	9	1,9049	1,9680	2,0539
20Y	2,0120	11	12	1,9537	2,0070	2,0527
30Y	2,0370	10	11	1,9592	1,9840	2,0023

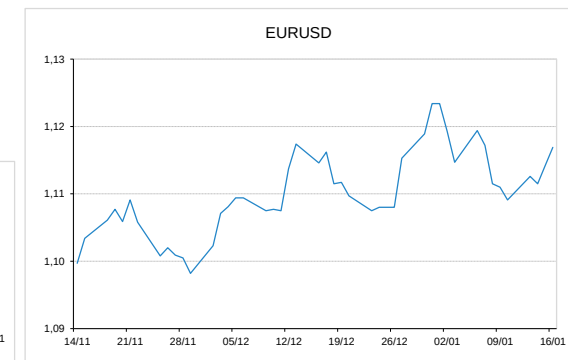
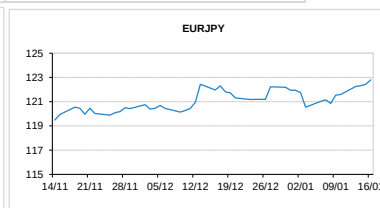


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,88	0,88	0,47	OT 2Y	-0,339	0,00	20,10
JETFUEL	617,71	-2,52	-27,88	OT 5Y	0,067	0,00	21,90
DIESEL	578,51	-3,99	-33,27	OT 10Y	0,517	0,01	16,30
COBRE	6.302,00	-15,00	157,00	BUND 10Y	-0,840	-1,45	3,20
ZINCO	2.393,75	13,75	138,25	SCHATZ 2Y	0,041	0,00	3,00
OURO	1.551,19	-2,88	76,00	T-NOTE 10Y	2,665	2,30	-6,40
TRIGO	565,00	-8,25	15,25	T-NOTE 2Y	2,038	1,34	-3,80
LICENÇA C02	24,88	0,37	-0,13	GILT 10Y	0,566	-0,44	-12,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1169	0,24%	0,21%	1,1232	1,1295	1,1421
EUR/GBP	0,8547	0,25%	-2,40%	0,8571	0,8595	0,8641
EUR/JPY	122,8	-0,30%	-0,68%	122,80	122,80	122,80
EUR/CHF	1,0743	0,08%	1,99%	1,0735	1,0726	1,0707
EUR/BRL	4,6637	0,05%	-3,00%	4,6902	4,7314	4,8651
EUR/PLN	4,2317	-0,09%	0,63%	4,2536	4,2771	4,3268



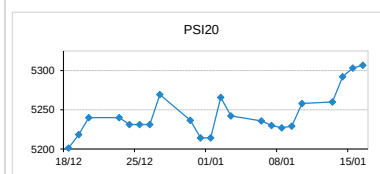
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1169	0,8547	122,80	1,0743	10,5637	7,4727	1,4519	1,61442	4,6637	9,8873
USD	0,8975	-	0,7653	110,115	0,9641	9,4856	6,7073	1,3042	1,4496	4,1795	8,8803

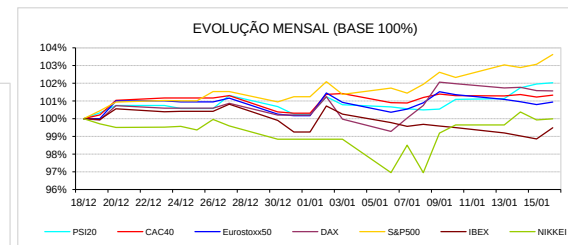
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,950	3,12	4,75
BCP	0,195	-1,26	-3,70
CORT. AMORIM	11,540	-0,69	2,12
CTT	3,246	-0,86	1,76
EDP	4,077	0,94	5,51
EDP R	10,780	0,75	2,67
GALP	15,145	0,20	1,64
IBERSOL	8,400	0,24	5,00
J MARTINS	15,640	-1,32	6,65
MOTA ENGIL	1,824	0,88	-2,46
NAVIGATOR	3,380	0,48	-1,99
NOS	4,928	0,37	2,67
NOVABASE	2,690	-0,37	4,26
PHAROL	0,102	0,79	2,21
RAMADA	5,800	1,05	-0,68
REN	13,180	1,23	-3,94
SEMAPA	0,791	1,02	5,05
SONAE CAP.	0,883	0,23	-2,97
SONAE SGPS	5,800	1,05	-0,68

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	3,12
REN	1,23
RAMADA	1,05
RAMADA	1,05
SEMAPA	1,02
NOVABASE	-0,37
CORT. AMORIM	-0,69
CTT	-0,86
BCP	-1,26
J MARTINS	-1,32



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.306,80	0,07%	1,78%	5.429,32	4.699,20
CAC40	6.039,03	0,11%	1,02%	6.071,66	4.772,64
ESTX 50 PR	3.774,14	0,14%	0,77%	3.807,09	3.053,08
XTRA DAX	13.429,43	-0,02%	1,36%	13.548,20	10.822,25
S&P 500	3.306,87	0,53%	2,35%	3.308,33	2.606,36
IBEX 35	9.572,50	0,64%	0,24%	9.705,40	8.409,20
NIKKEI 225	23.933,13	0,07%	1,17%	24.091,12	20.110,76



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.