

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

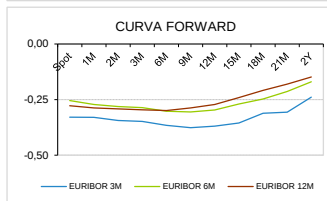
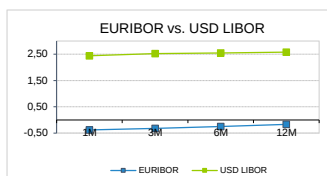
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

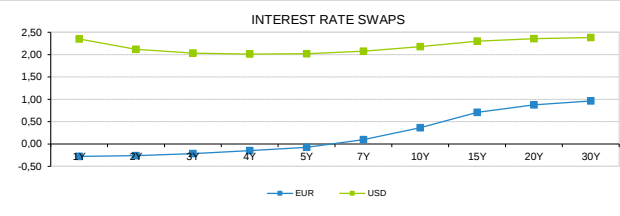
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3780	0	-1	1M	2,4400	0	-4	0,7253	-0,8016
3M	-0,3220	0	-1	3M	2,5203	0	-6	0,7960	-0,7124
6M	-0,2500	0	-2	6M	2,5438	2	-8	0,8859	-0,6612
12M	-0,1680	-1	-5	12M	2,5781	1	-14	1,0101	-0,5224

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2775	0	-5	-0,2721	0,0176	0,3924
2Y	-0,2600	0	-7	-0,2100	0,1124	0,4925
3Y	-0,2160	0	-9	-0,1345	0,2058	0,5919
4Y	-0,1500	0	-11	-0,0496	0,3028	0,6901
5Y	-0,0750	0	-12	0,0385	0,3997	0,7730
7Y	0,0970	0	-14	0,2235	0,5841	0,9191
10Y	0,3650	0	-16	0,4851	0,7929	1,0680
15Y	0,7060	0	-16	0,7710	0,9854	1,1731
20Y	0,8770	0	-16	0,9103	1,0580	1,1788
30Y	0,9620	0	-15	0,9632	1,0518	1,1181

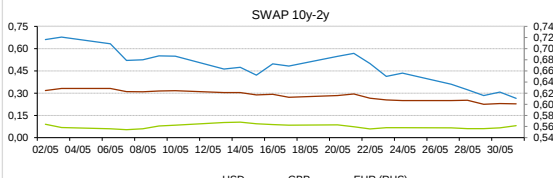
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,3500	-4	-19	1,7945	1,8675	2,1115
2Y	2,1160	-6	-28	1,7986	1,9570	2,1460
3Y	2,0320	-6	-31	1,8200	2,0030	2,1780
4Y	2,0110	-6	-31	1,8630	2,0450	2,2320
5Y	2,0200	-6	-32	1,9110	2,0900	2,2959
7Y	2,0740	-6	-33	1,9970	2,1740	2,3285
10Y	2,1770	-6	-33	2,1200	2,2640	2,3800
15Y	2,3000	-6	-33	2,2543	2,3350	2,4110
20Y	2,3550	-6	-33	2,2830	2,3550	2,4060
30Y	2,3820	-5	-33	2,3020	2,3445	2,3710

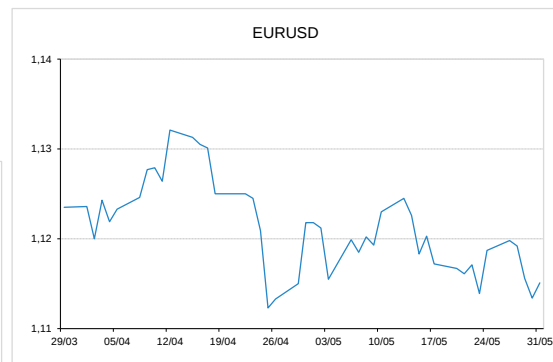
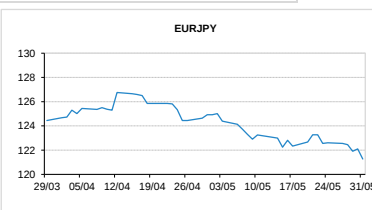
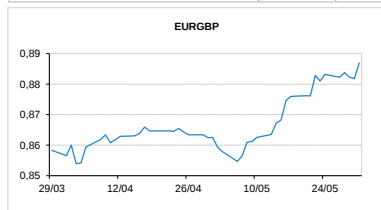


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,60	-2,27	-7,46	OT 2Y	-0,394	0,01	-4,60
JETFUEL	611,50	-23,16	-58,75	OT 5Y	-0,040	-0,01	-12,10
DIESEL	580,25	-23,66	-62,75	OT 10Y	0,810	-0,05	-30,50
COBRE	5.858,00	-31,00	-563,00	BUND 10Y	-0,615	-3,11	-22,40
ZINCO	2.665,00	20,00	-206,00	SCHATZ 2Y	-0,046	-1,60	-8,30
OURO	1.301,95	14,73	18,34	T-NOTE 10Y	2,928	-4,58	-27,20
TRIGO	508,75	-5,75	80,00	T-NOTE 2Y	2,283	-7,89	-31,10
LICENÇA C02	24,48	-0,82	-1,81	GILT 10Y	0,885	-1,26	-28,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1151	0,15%	-0,60%	1,1236	1,1316	1,1470
EUR/GBP	0,88693	-0,58%	-2,76%	0,8897	0,8925	0,8986
EUR/JPY	121,27	0,68%	3,02%	121,27	121,27	121,27
EUR/CHF	1,1187	0,32%	2,14%	1,1176	1,1165	1,1143
EUR/BRL	4,3748	1,30%	0,46%	4,4436	4,5085	4,6299
EUR/PLN	4,2821	0,16%	0,12%	4,3039	4,3259	4,3743



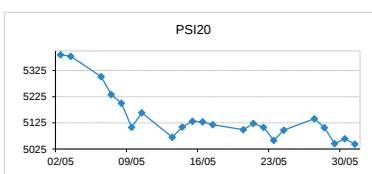
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1151	0,8869	121,27	1,1187	10,6048	7,4678	1,5078	1,6087	4,3748	9,7601
USD	0,8972	-	0,7932	108,585	1,0056	9,5214	6,6999	1,3518	1,4435	3,9126	8,7548

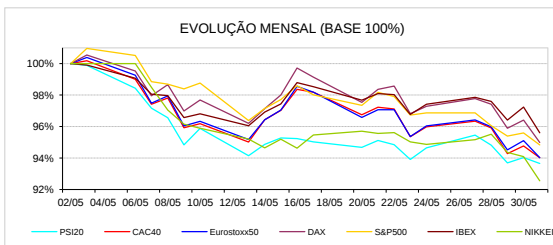
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,070	3,85	4,66
BCP	0,252	-0,47	9,80
CORT. AMORIM	10,300	1,38	14,44
CTT	2,320	0,00	-21,25
EDP	3,259	-0,34	6,89
EDP R	8,900	1,60	14,47
GALP	13,480	-1,03	-2,28
IBERSOL	8,100	0,50	2,53
J MARTINS	13,625	-1,91	31,77
MOTA ENGIL	2,118	0,00	31,55
NAVIGATOR	3,200	-0,50	-11,11
NOS	5,655	-1,14	6,80
NOVABASE	2,280	-0,44	12,87
PHAROL	0,143	-0,14	-12,13
RAMADA	7,620	0,53	1,60
REN	12,440	-0,64	-5,04
SEMAPA	0,759	-0,13	-10,60
SONAE CAP.	0,890	0,17	9,88
SONAE SGPS	7,620	0,53	1,60

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	3,85
EDP R	1,60
CORT. AMORIM	1,38
RAMADA	0,53
RAMADA	0,53
NAVIGATOR	-0,50
REN	-0,64
GALP	-1,03
NOS	-1,14
J MARTINS	-1,91



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.043,99	-0,40%	6,61%	5.701,90	4.551,84
CAC40	5.207,63	-0,79%	10,08%	5.601,38	4.555,99
ESTX 50 PR	3.280,43	-1,14%	9,30%	3.540,64	2.908,70
XTRA DAX	11.726,84	-1,47%	11,06%	13.170,05	10.279,20
S&P 500	2.766,33	-0,79%	10,37%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.004,20	-1,68%	5,44%	9.985,90	8.286,20
NIKKEI 225	20.601,19	-1,63%	2,93%	24.448,07	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.