

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

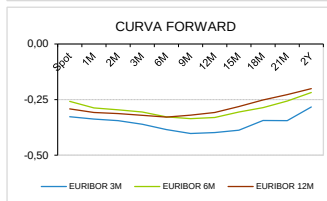
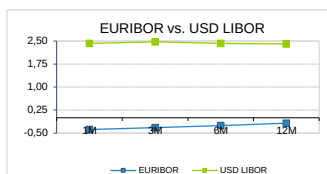
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

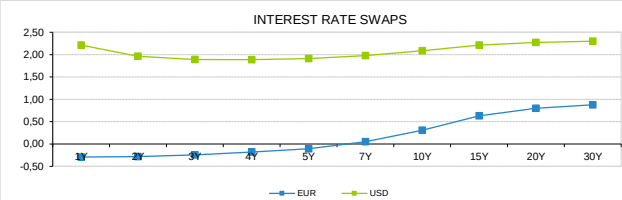
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3830	0	-2	1M	2,4209	-1	-5	0,7260	-0,8022
3M	-0,3200	0	-1	3M	2,4744	0	-9	0,7926	-0,7136
6M	-0,2540	0	-2	6M	2,4243	-3	-19	0,8686	-0,6568
12M	-0,1770	0	-6	12M	2,4053	-1	-34	0,9860	-0,5172

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2923	-1	-6	-0,3086	-0,0550	0,3240
2Y	-0,2810	0	-9	-0,2562	0,0300	0,4288
3Y	-0,2430	0	-12	-0,1880	0,1280	0,5306
4Y	-0,1810	0	-14	-0,1110	0,2300	0,6270
5Y	-0,1080	-1	-16	-0,0232	0,3300	0,7080
7Y	0,0530	-1	-20	0,1634	0,5130	0,8470
10Y	0,3090	-2	-23	0,4216	0,7217	0,9900
15Y	0,6300	-2	-25	0,7037	0,9129	1,0960
20Y	0,7970	-2	-26	0,8432	0,9878	1,1040
30Y	0,8770	-3	-26	0,8971	0,9816	1,0460

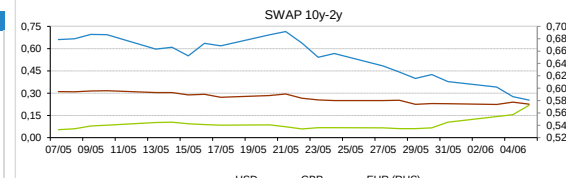
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,25
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,2110	-16	-34	1,6431	1,8679	2,1405
2Y	1,9620	-7	-47	1,6540	1,9290	2,1980
3Y	1,8900	-7	-48	1,7200	1,9885	2,2510
4Y	1,8870	-6	-47	1,7900	2,0610	2,3116
5Y	1,9110	-5	-46	1,8560	2,1180	2,3555
7Y	1,9770	-4	-44	1,9966	2,2100	2,4143
10Y	2,0870	-4	-42	2,1414	2,3060	2,4654
15Y	2,2140	-3	-41	2,2724	2,3820	2,4959
20Y	2,2720	-3	-40	2,3306	2,4254	2,4900
30Y	2,2990	-3	-39	2,3566	2,4181	2,4270

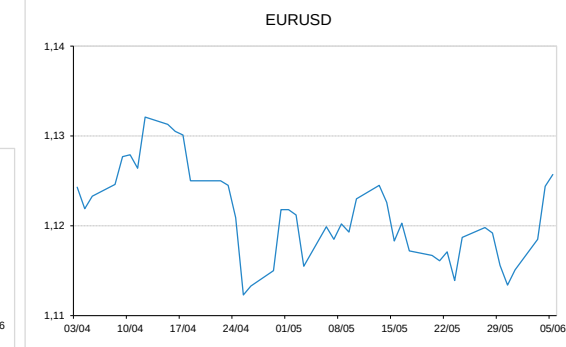
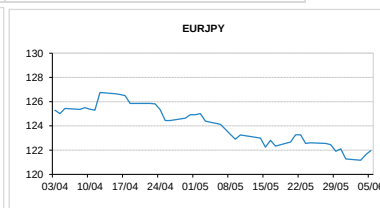
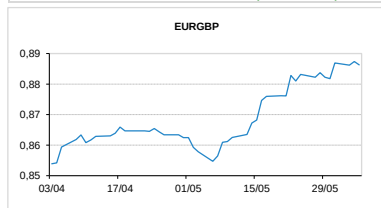


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	59,71	-2,26	-10,32	OT 2Y	-0,389	0,00	-5,50
JETFUEL	597,05	-1,73	-79,48	OT 5Y	-0,088	-0,03	-17,50
DIESEL	564,51	-1,27	-85,02	OT 10Y	0,678	-0,04	-44,60
COBRE	5.894,50	37,00	-357,00	BUND 10Y	-0,803	-1,32	-24,90
ZINCO	2.579,50	2,50	-229,50	SCHATZ 2Y	-0,055	-2,06	-9,90
OURO	1.328,81	5,29	47,73	T-NOTE 10Y	2,876	-0,31	-32,00
TRIGO	498,25	-9,00	60,25	T-NOTE 2Y	2,135	-2,68	-46,60
LICENÇA C02	24,26	-0,30	-0,94	GILT 10Y	0,863	-3,25	-36,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1257	0,12%	0,52%	1,1342	1,1418	1,1560
EUR/GBP	0,88631	0,12%	-3,57%	0,8891	0,8920	0,8981
EUR/JPY	121,96	-0,28%	1,78%	121,96	121,96	121,96
EUR/CHF	1,1160	0,16%	2,10%	1,1148	1,1138	1,1116
EUR/BRL	4,346	-0,09%	2,28%	4,4130	4,4762	4,5937
EUR/PLN	4,2756	0,09%	0,21%	4,2975	4,3199	4,3675



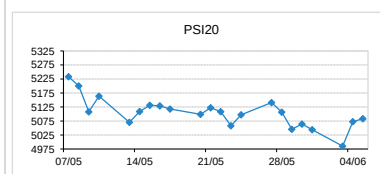
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1257	0,8863	121,96	1,1160	10,6114	7,4684	1,5072	1,61216	4,3460	9,8105
USD	0,8879	-	0,7856	108	0,9895	9,4278	6,6315	1,3401	1,4317	3,8742	8,7126

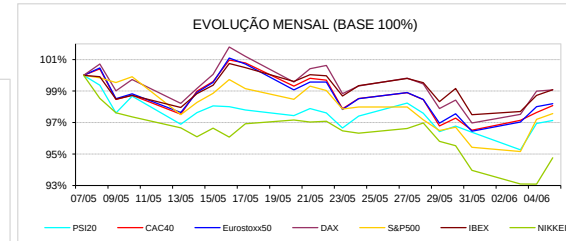
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,965	-2,21	2,84
BCP	0,253	-0,75	10,24
CORT. AMORIM	9,970	-2,06	10,78
CTT	2,282	-0,09	-22,54
EDP	3,344	0,60	9,68
EDP R	9,050	0,56	16,40
GALP	13,380	0,00	-3,01
IBERSOL	7,960	-0,50	0,76
J MARTINS	14,215	2,16	37,48
MOTA ENGIL	1,935	3,14	20,19
NAVIGATOR	3,186	-1,36	-11,50
NOS	5,675	0,00	7,18
NOVABASE	2,190	0,00	8,42
PHAROL	0,144	0,00	-11,52
RAMADA	7,480	0,54	-0,27
REN	12,360	-0,96	-5,65
SEMAPA	0,760	1,06	-10,48
SONAE CAP.	0,904	1,57	11,60
SONAE SGPS	7,480	0,54	-0,27

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
MOTA ENGIL	3,14
J MARTINS	2,16
SONAE CAP.	1,57
SEMAPA	1,06
EDP	0,60
BCP	-0,75
REN	-0,96
NAVIGATOR	-1,36
CORT. AMORIM	-2,06
ALTRI	-2,21



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.082,97	0,20%	7,43%	5.701,90	4.551,84
CAC40	5.292,00	0,45%	11,87%	5.601,38	4.555,99
ESTX 50 PR	3.339,95	0,19%	11,28%	3.540,64	2.908,70
XTRA DAX	11.980,81	0,08%	13,47%	13.170,05	10.279,20
S&P 500	2.813,82	0,38%	12,25%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.150,50	0,36%	7,15%	9.985,90	8.286,20
NIKKEI 225	20.776,10	1,80%	3,80%	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.