

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

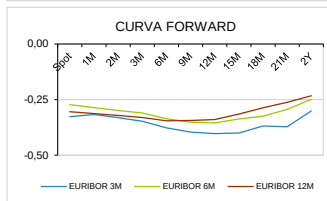
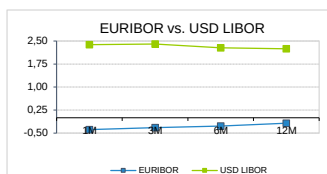
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

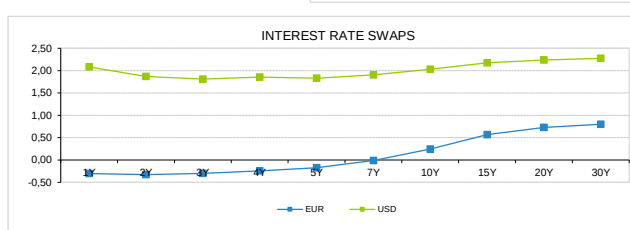
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3850	-1	-2	1M	2,3818	-1	-6	0,7260	-0,8024
3M	-0,3200	0	-1	3M	2,4020	-1	-12	0,7875	-0,7118
6M	-0,2680	-1	-3	6M	2,2774	-4	-27	0,8714	-0,6658
12M	-0,1770	-1	-4	12M	2,2465	-6	-39	0,9838	-0,5452

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3045	0	-5	-0,3410	-0,0623	0,3108
2Y	-0,3270	-1	-11	-0,2865	0,0335	0,4072
3Y	-0,2990	-1	-14	-0,2120	0,1259	0,5074
4Y	-0,2430	-1	-16	-0,1268	0,2206	0,6002
5Y	-0,1740	-2	-17	-0,0395	0,3158	0,6822
7Y	-0,0130	-2	-20	0,1433	0,4953	0,8220
10Y	0,2460	-2	-22	0,3986	0,6976	0,9634
15Y	0,5670	-3	-23	0,6747	0,8822	1,0634
20Y	0,7290	-3	-24	0,8085	0,9494	1,0636
30Y	0,8000	-5	-24	0,8481	0,9305	0,9933

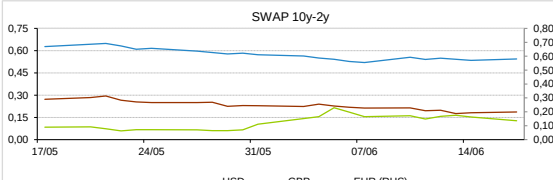
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,25
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,0840	-4	-35	1,6591	1,7706	2,0050
2Y	1,8700	-3	-40	1,6638	1,8100	2,0675
3Y	1,8100	-3	-40	1,6992	1,8720	2,1200
4Y	1,8530	-7	-40	1,7300	1,9350	2,1630
5Y	1,8290	-3	-39	1,7971	1,9910	2,2221
7Y	1,9050	-3	-37	1,8905	2,0830	2,2650
10Y	2,0290	-3	-35	2,0220	2,1954	2,3190
15Y	2,1720	-3	-33	2,1691	2,2640	2,3780
20Y	2,2380	-3	-31	2,2100	2,3088	2,3752
30Y	2,2740	-3	-30	2,2516	2,3034	2,3424

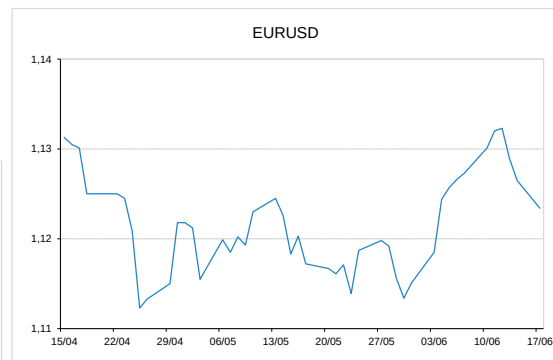
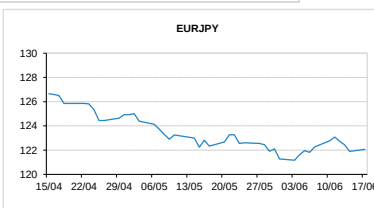
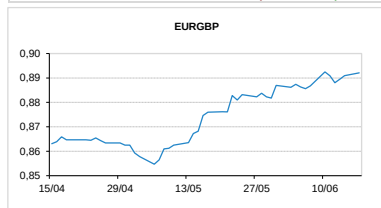


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	61,69	-0,32	-9,57	OT 2Y	-0,329	-0,01	2,10
JETFUEL	597,25	-7,00	-96,50	OT 5Y	-0,043	0,02	-10,90
DIESEL	561,50	-7,75	-97,50	OT 10Y	0,641	0,03	-43,80
COBRE	5.807,50	-36,00	-205,00	BUND 10Y	-0,833	1,45	-16,30
ZINCO	2.561,00	-21,00	-83,25	SCHATZ 2Y	-0,073	0,00	-5,50
OURO	1.340,93	-6,27	65,02	T-NOTE 10Y	2,840	-0,47	-26,70
TRIGO	544,00	2,00	72,75	T-NOTE 2Y	2,177	0,96	-31,20
LICENÇA C02	25,02	-0,03	0,02	GILT 10Y	0,851	1,08	-22,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1234	-0,28%	0,56%	1,1317	1,1391	1,1535
EUR/GBP	0,89208	-0,13%	-1,81%	0,8949	0,8979	0,9043
EUR/JPY	122,06	-0,13%	0,23%	122,06	122,06	122,06
EUR/CHF	1,1215	-0,17%	0,58%	1,1204	1,1193	1,1170
EUR/BRL	4,3708	-0,06%	4,60%	4,4366	4,4970	4,6141
EUR/PLN	4,2606	-0,08%	1,07%	4,2816	4,3039	4,3526



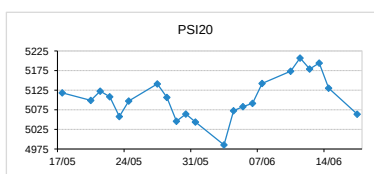
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1234	0,8921	122,06	1,1215	10,6370	7,4678	1,5056	1,6378	4,3708	9,7881
USD	0,8907	-	0,7961	108,665	0,9993	9,4848	6,6513	1,3400	1,4592	3,8923	8,7193

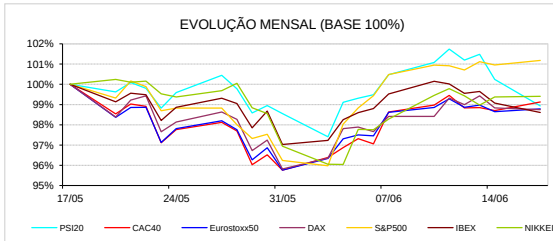
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,050	-3,43	4,31
BCP	0,252	-1,87	9,80
CORT. AMORIM	10,160	0,79	12,89
CTT	2,112	-2,22	-28,31
EDP	3,410	-0,93	11,84
EDP R	9,090	-1,20	16,91
GALP	12,870	-2,13	-6,71
IBERSOL	8,080	-0,25	2,28
J MARTINS	14,200	-1,29	37,33
MOTA ENGIL	1,840	-1,23	14,29
NAVIGATOR	3,208	-1,60	-10,89
NOS	5,740	0,09	8,40
NOVABASE	2,270	-1,73	12,38
PHAROL	0,152	-1,81	-7,11
RAMADA	7,560	0,27	0,80
REN	11,960	-1,97	-8,70
SEMAPA	0,745	-1,06	-12,25
SONAE CAP.	0,879	-0,68	8,52
SONAE SGPS	7,560	0,27	0,80

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	0,79
RAMADA	0,27
RAMADA	0,27
NOS	0,09
BCP	-1,87
REN	-1,97
GALP	-2,13
CTT	-2,22
ALTRI	-3,43



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.063,67	-1,30%	7,02%	5.686,45	4.551,84
CAC40	5.390,95	0,43%	13,96%	5.601,38	4.555,99
ESTX 50 PR	3.383,96	0,14%	12,75%	3.540,64	2.908,70
XTRA DAX	12.085,82	-0,09%	14,46%	13.170,05	10.279,20
S&P 500	2.893,33	0,22%	15,42%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.151,30	-0,47%	7,16%	9.985,90	8.286,20
NIKKEI 225	21.124,00	0,03%	5,54%	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.