

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

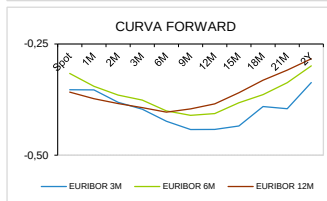
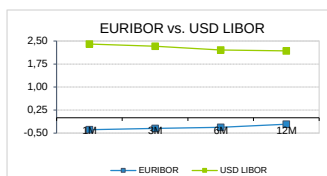
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

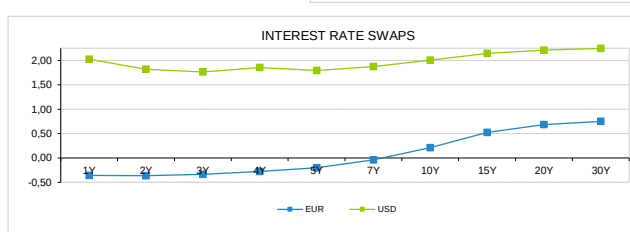
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3890	0	-2	1M	2,4018	0	-3	0,7218	-0,8072
3M	-0,3450	0	-3	3M	2,3329	-2	-19	0,7728	-0,7250
6M	-0,3110	0	-7	6M	2,2099	-1	-34	0,8594	-0,6826
12M	-0,2100	0	-6	12M	2,1788	-2	-44	0,9554	-0,5828

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3582	0	-10	-0,3861	-0,1272	0,2333
2Y	-0,3640	0	-12	-0,3340	-0,0347	0,3278
3Y	-0,3340	0	-13	-0,2639	0,0536	0,4216
4Y	-0,2760	-1	-14	-0,1854	0,1454	0,5126
5Y	-0,2020	-1	-15	-0,1014	0,2370	0,5853
7Y	-0,0400	-1	-17	0,0740	0,4070	0,7229
10Y	0,2110	-1	-20	0,3190	0,6047	0,8616
15Y	0,5240	-1	-23	0,5870	0,7852	0,9603
20Y	0,6830	-2	-24	0,7175	0,8514	0,9555
30Y	0,7500	-2	-26	0,7535	0,8286	0,8830

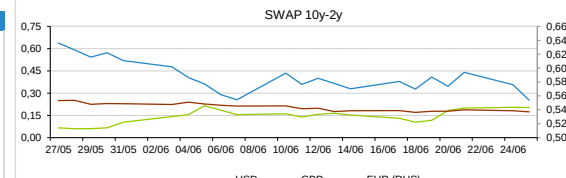
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,25
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,0240	-11	-44	1,5137	1,6460	1,9290
2Y	1,8190	9	-50	1,5017	1,7180	1,9880
3Y	1,7630	9	-49	1,5355	1,7880	2,0440
4Y	1,8530	-7	-40	1,6186	1,8711	2,1119
5Y	1,7930	10	-45	1,6650	1,9289	2,1589
7Y	1,8740	9	-42	1,8017	2,0120	2,2248
10Y	2,0040	9	-39	1,9315	2,1353	2,2610
15Y	2,1450	8	-36	2,0911	2,1930	2,2875
20Y	2,2120	7	-35	2,1360	2,2200	2,2960
30Y	2,2470	7	-33	2,1720	2,2320	2,2690

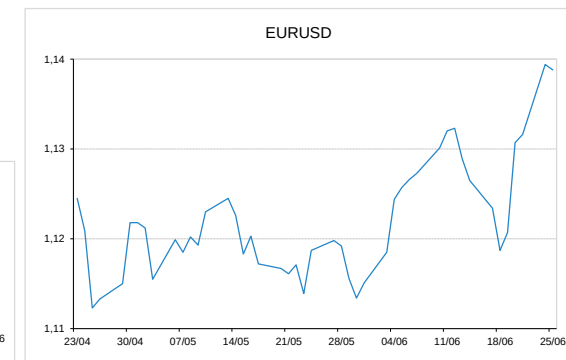
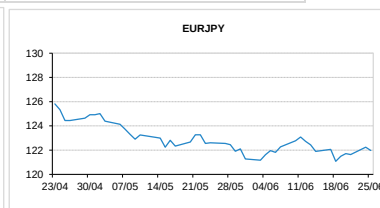
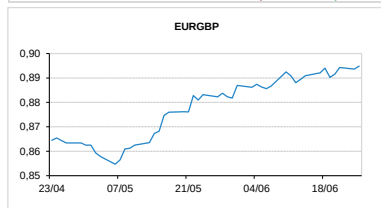


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	65,29	0,43	-2,18	OT 2Y	-0,429	-0,03	-3,40
JETFUEL	630,00	9,41	-9,91	OT 5Y	-0,155	-0,04	-17,50
DIESEL	593,00	9,66	-17,16	OT 10Y	0,482	-0,04	-49,40
COBRE	5.965,00	-11,00	5,00	BUND 10Y	-0,921	-2,60	-22,80
ZINCO	2.555,00	65,50	-50,00	SCHATZ 2Y	-0,124	-0,69	-10,80
OURO	1.428,14	13,06	143,56	T-NOTE 10Y	2,754	-2,64	-30,40
TRIGO	541,50	-1,00	44,75	T-NOTE 2Y	2,038	-2,48	-41,40
LICENÇA C02	26,35	-0,02	0,88	GILT 10Y	0,788	-1,79	-16,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1388	-0,05%	1,70%	1,1469	1,1541	1,1682
EUR/GBP	0,89485	-0,13%	-1,41%	0,8977	0,9007	0,9072
EUR/JPY	121,97	0,23%	0,48%	121,97	121,97	121,97
EUR/CHF	1,1074	0,06%	1,48%	1,1062	1,1051	1,1027
EUR/BRL	4,3606	-0,03%	3,72%	4,4270	4,4870	4,6147
EUR/PLN	4,2545	-0,04%	0,81%	4,2761	4,2991	4,3483



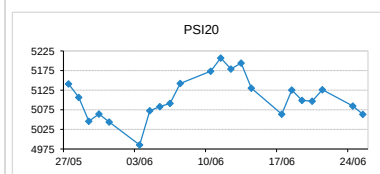
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1388	0,8949	121,97	1,1074	10,5404	7,4656	1,4986	1,63234	4,3606	9,6891
USD	0,8786	-	0,7861	106,955	0,9729	9,2667	6,5592	1,3178	1,4350	3,8323	8,5185

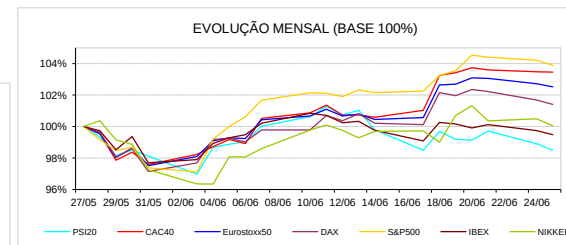
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,850	5,41	0,86
BCP	0,261	0,50	13,68
CORT. AMORIM	10,280	-2,65	14,22
CTT	2,040	-2,58	-30,75
EDP	3,355	-0,45	10,04
EDP R	8,970	-0,11	15,37
GALP	13,165	-1,24	-4,57
IBERSOL	7,940	-1,98	0,51
J MARTINS	14,240	0,00	37,72
MOTA ENGIL	1,836	-0,70	14,04
NAVIGATOR	3,252	0,62	-9,67
NOS	5,740	-1,37	8,40
NOVABASE	2,340	4,00	15,84
PHAROL	0,149	-0,67	-8,70
RAMADA	7,200	0,84	-4,00
REN	12,120	-1,62	-7,48
SEMAPA	0,692	-0,86	-18,49
SONAE CAP.	0,828	-2,13	2,16
SONAE SGPS	7,200	0,84	-4,00

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	5,41
NOVABASE	4,00
RAMADA	0,84
RAMADA	0,84
NAVIGATOR	0,62
REN	-1,62
IBERSOL	-1,98
SONAE CAP.	-2,13
CTT	-2,58
CORT. AMORIM	-2,65



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.063,47	-0,42%	7,02%	5.686,45	4.551,84
CAC40	5.520,91	-0,01%	16,70%	5.601,38	4.555,99
ESTX 50 PR	3.448,86	-0,19%	14,91%	3.536,87	2.908,70
XTRA DAX	12.240,56	-0,28%	15,93%	12.886,83	10.279,20
S&P 500	2.935,96	-0,32%	17,12%	2.964,15	2.346,58
IBEX 35	9.169,20	-0,25%	7,37%	9.971,60	8.286,20
NIKKEI 225	21.193,81	-0,43%	5,89%	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.