

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

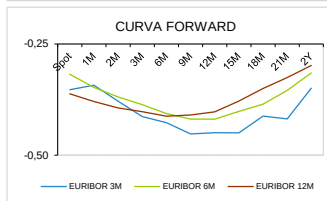
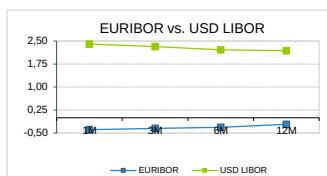
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

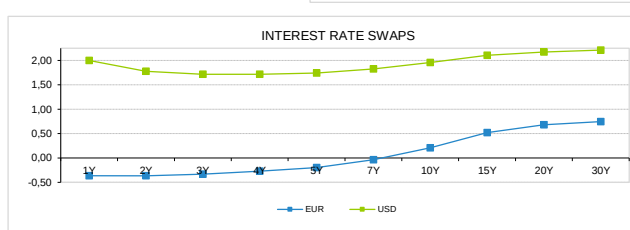
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3880	0	-1	1M	2,4024	0	-3	0,7218	-0,8094
3M	-0,3450	0	-3	3M	2,3189	-1	-21	0,7688	-0,7272
6M	-0,3110	0	-7	6M	2,2134	1	-34	0,8540	-0,6922
12M	-0,2140	0	-6	12M	2,1846	0	-43	0,9553	-0,5824

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3630	0	-10	-0,4027	-0,1360	0,2310
2Y	-0,3660	0	-12	-0,3645	-0,0536	0,3259
3Y	-0,3320	1	-13	-0,2794	0,0474	0,4208
4Y	-0,2710	1	-13	-0,1977	0,1383	0,5088
5Y	-0,1970	2	-14	-0,1109	0,2329	0,5860
7Y	-0,0380	2	-16	0,0676	0,4046	0,7210
10Y	0,2090	2	-19	0,3135	0,6080	0,8637
15Y	0,5200	2	-22	0,5918	0,7989	0,9673
20Y	0,6800	2	-23	0,7246	0,8639	0,9694
30Y	0,7460	2	-25	0,7640	0,8425	0,8968

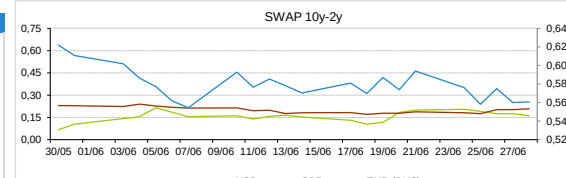
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,25
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,9990	6	-40	1,5847	1,7190	1,9560
2Y	1,7780	6	-41	1,5750	1,7828	2,0135
3Y	1,7170	6	-40	1,6160	1,8275	2,0740
4Y	1,7160	6	-38	1,6680	1,8860	2,1150
5Y	1,7430	6	-37	1,7235	1,9435	2,1806
7Y	1,8270	5	-34	1,8340	2,0360	2,2205
10Y	1,9570	5	-31	1,9927	2,1410	2,3046
15Y	2,1040	4	-28	2,1264	2,2454	2,3420
20Y	2,1740	4	-27	2,1660	2,2746	2,3170
30Y	2,2120	4	-25	2,2166	2,2681	2,2870

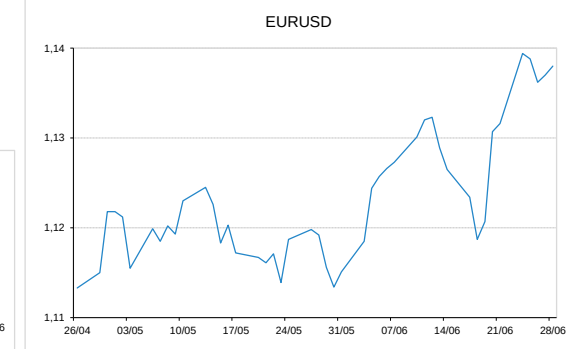
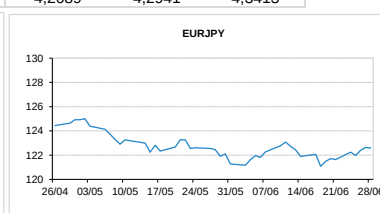


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	66,73	0,18	-1,94	OT 2Y	-0,421	0,00	-2,10
JETFUEL	639,50	2,75	-14,16	OT 5Y	-0,169	-0,02	-13,40
DIESEL	600,50	2,00	-22,91	OT 10Y	0,476	-0,01	-37,40
COBRE	6.002,50	1,00	34,00	BUND 10Y	-0,916	-1,10	-16,30
ZINCO	2.528,00	-33,00	-77,00	SCHATZ 2Y	-0,130	-0,91	-10,00
OURO	1.412,65	4,95	134,76	T-NOTE 10Y	2,782	0,16	-19,80
TRIGO	548,00	1,25	36,00	T-NOTE 2Y	2,105	0,96	-25,90
LICENÇA C02	26,25	-0,64	0,77	GILT 10Y	0,825	0,45	-8,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,138	0,09%	1,68%	1,1462	1,1542	1,1680
EUR/GBP	0,89655	-0,25%	-1,43%	0,8994	0,9026	0,9089
EUR/JPY	122,6	0,03%	-0,12%	122,60	122,60	122,60
EUR/CHF	1,1096	0,05%	1,54%	1,1084	1,1072	1,1050
EUR/BRL	4,3577	-0,38%	3,06%	4,4276	4,4927	4,6206
EUR/PLN	4,2470	0,11%	1,17%	4,2689	4,2941	4,3413



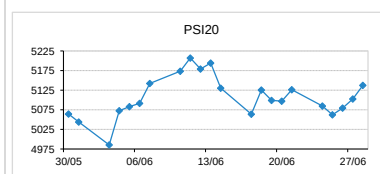
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1380	0,8966	122,60	1,1096	10,5625	7,4637	1,4886	1,62186	4,3577	9,7026
USD	0,8782	-	0,7857	107,705	0,9753	9,2769	6,5546	1,3067	1,4251	3,8331	8,5283

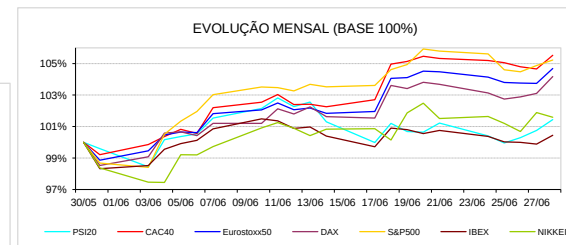
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,105	0,99	5,26
BCP	0,272	1,42	18,47
CORT. AMORIM	10,180	0,20	13,11
CTT	2,116	2,42	-28,17
EDP	3,342	0,15	9,61
EDP R	9,020	0,11	16,01
GALP	13,525	0,60	-1,96
IBERSOL	8,040	-0,50	1,77
J MARTINS	14,165	-0,21	36,99
MOTA ENGIL	1,905	0,69	18,32
NAVIGATOR	3,358	0,30	-6,72
NOS	5,780	1,05	9,16
NOVABASE	2,400	1,69	18,81
PHAROL	0,151	0,67	-7,48
RAMADA	7,040	-0,85	-6,13
REN	12,360	0,49	-5,65
SEMAPA	0,729	1,96	-14,13
SONAE CAP.	0,850	2,72	4,88
SONAE SGPS	7,040	-0,85	-6,13

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE CAP.	2,72
CTT	2,42
SEMAPA	1,96
NOVABASE	1,69
BCP	1,42
J MARTINS	-0,21
IBERSOL	-0,50
RAMADA	-0,85
RAMADA	-0,85



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.137,47	0,68%	8,58%	5.686,45	4.551,84
CAC40	5.538,97	0,83%	17,09%	5.601,38	4.555,99
ESTX 50 PR	3.473,69	0,91%	15,73%	3.536,87	2.908,70
XTRA DAX	12.398,80	1,04%	17,42%	12.886,83	10.279,20
S&P 500	2.934,47	0,33%	17,06%	2.964,15	2.346,58
IBEX 35	9.198,80	0,56%	7,72%	9.971,60	8.286,20
NIKKEI 225	21.275,92	-0,29%	6,30%	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.