

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

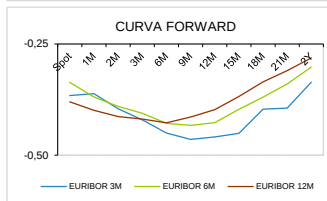
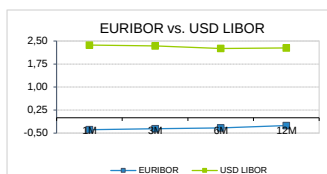
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

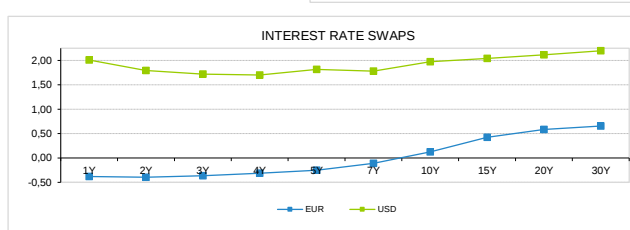
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3890	0	-1	1M	2,3686	-1	-4	0,7215	-0,8114
3M	-0,3580	0	-4	3M	2,3408	0	-11	0,7713	-0,7460
6M	-0,3290	1	-7	6M	2,2568	0	-12	0,8180	-0,7024
12M	-0,2530	1	-8	12M	2,2735	1	-7	0,8874	-0,5892

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3802	0	-9	-0,3976	-0,1255	0,2340
2Y	-0,3950	1	-11	-0,3392	-0,0303	0,3262
3Y	-0,3650	1	-11	-0,2677	0,0569	0,4180
4Y	-0,3140	2	-11	-0,1838	0,1472	0,5050
5Y	-0,2520	2	-12	-0,1022	0,2377	0,5845
7Y	-0,1090	2	-13	0,0714	0,4047	0,7050
10Y	0,1230	3	-15	0,3115	0,5931	0,8410
15Y	0,4230	3	-16	0,5752	0,7738	0,9440
20Y	0,5840	3	-17	0,7080	0,8421	0,9460
30Y	0,6550	3	-18	0,7462	0,8196	0,8700

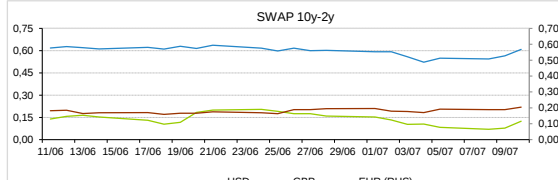
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,0090	1	-38	1,6876	1,7245	1,9660
2Y	1,7930	-3	-17	1,6510	1,7770	2,0245
3Y	1,7200	-3	-17	1,6680	1,8355	2,0765
4Y	1,7010	-4	-19	1,7055	1,8965	2,1270
5Y	1,8150	10	-3	1,7545	1,9540	2,1886
7Y	1,7800	-5	-20	1,8600	2,0420	2,2260
10Y	1,9730	8	-7	1,9960	2,1520	2,2820
15Y	2,0420	-6	-17	2,1200	2,2260	2,3130
20Y	2,1140	-7	-16	2,2047	2,2525	2,3240
30Y	2,1980	5	-9	2,2055	2,2555	2,2930

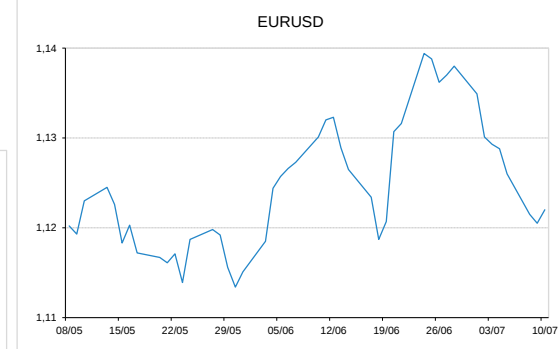
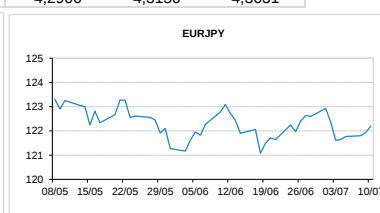
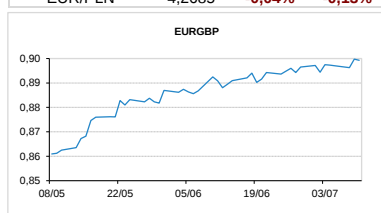


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	66,37	2,21	5,03	OT 2Y	-0,434	0,01	-8,00
JETFUEL	623,59	3,67	25,17	OT 5Y	-0,149	0,02	-7,10
DIESEL	586,59	1,42	20,67	OT 10Y	0,505	0,03	-17,90
COBRE	5.823,00	-70,00	23,00	BUND 10Y	-0,897	5,08	-9,40
ZINCO	2.356,50	-15,00	-165,50	SCHATZ 2Y	-0,115	0,23	-6,40
OURO	1.409,40	12,48	82,04	T-NOTE 10Y	2,820	-2,50	-7,90
TRIGO	502,00	-0,75	-9,75	T-NOTE 2Y	2,199	-7,10	-1,50
LICENÇA C02	28,29	1,73	3,09	GILT 10Y	0,749	3,82	-8,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,122	0,13%	-0,72%	1,1304	1,1383	1,1526
EUR/GBP	0,89928	0,05%	-0,76%	0,9022	0,9053	0,9113
EUR/JPY	122,2	-0,22%	0,47%	122,20	122,20	122,20
EUR/CHF	1,1140	-0,08%	0,51%	1,1128	1,1116	1,1096
EUR/BRL	4,2398	0,50%	3,80%	4,3049	4,3621	4,4783
EUR/PLN	4,2685	-0,04%	-0,13%	4,2906	4,3150	4,3631



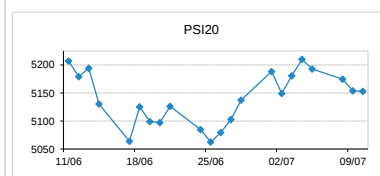
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1220	0,8993	122,20	1,1140	10,5958	7,4644	1,4755	1,61759	4,2398	9,6641
USD	0,8888	-	0,8003	108,545	0,9900	9,4194	6,6336	1,3116	1,4377	3,7746	8,5880

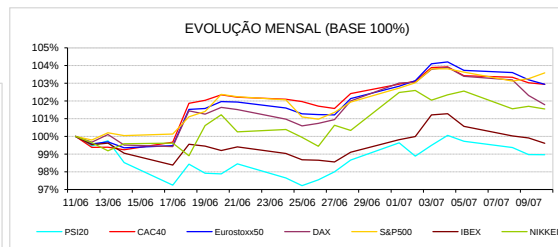
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,960	0,59	2,76
BCP	0,283	0,96	23,40
CORT. AMORIM	9,960	-0,60	10,67
CTT	2,022	0,20	-31,36
EDP	3,350	-0,77	9,87
EDP R	9,050	-0,33	16,40
GALP	13,500	0,11	-2,14
IBERSOL	8,120	0,00	2,78
J MARTINS	14,260	-0,42	37,91
MOTA ENGIL	1,888	0,16	17,27
NAVIGATOR	3,212	-0,06	-10,78
NOS	5,645	-0,09	6,61
NOVABASE	2,320	-2,52	14,85
PHAROL	0,152	0,66	-7,11
RAMADA	7,060	0,57	-5,87
REN	12,560	-1,10	-4,12
SEMAPA	0,734	-1,34	-13,55
SONAE CAP.	0,857	0,35	5,74
SONAE SGPS	7,060	0,57	-5,87

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	0,96
PHAROL	0,66
ALTRI	0,59
RAMADA	0,57
RAMADA	0,57
CORT. AMORIM	-0,60
EDP	-0,77
REN	-1,10
SEMAPA	-1,34
NOVABASE	-2,52



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.153,06	-0,01%	8,91%	5.686,45	4.551,84
CAC40	5.567,59	-0,08%	17,69%	5.629,79	4.555,99
ESTX 50 PR	3.501,08	-0,25%	16,65%	3.549,26	2.908,70
XTRA DAX	12.373,41	-0,51%	17,18%	12.886,83	10.279,20
S&P 500	2.989,25	0,32%	19,24%	3.002,98	2.346,58
IBEX 35	9.246,00	-0,30%	8,27%	9.938,00	8.286,20
NIKKEI 225	21.533,48	-0,15%	7,59%	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.