

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

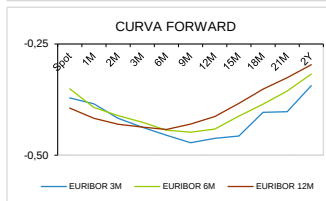
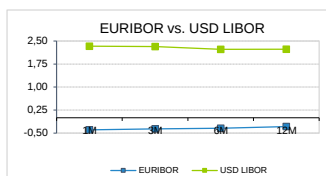
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

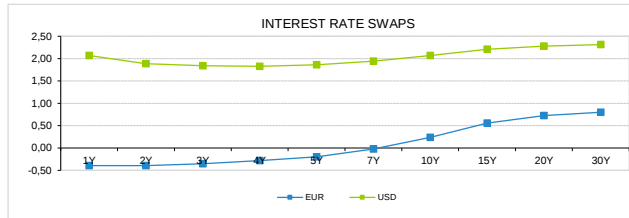
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3930	0	-2	1M	2,3320	1	-7	0,7210	-0,8130
3M	-0,3630	0	-5	3M	2,3223	2	-11	0,7675	-0,7472
6M	-0,3430	0	-8	6M	2,2293	2	-11	0,8159	-0,7070
12M	-0,2870	-1	-12	12M	2,2311	4	-10	0,9034	-0,5890

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3940	-1	-9	-0,4160	-0,1100	0,2763
2Y	-0,3930	0	-9	-0,3582	-0,0126	0,3673
3Y	-0,3510	1	-7	-0,2768	0,0823	0,4585
4Y	-0,2810	2	-6	-0,1838	0,1760	0,5457
5Y	-0,1990	3	-5	-0,0945	0,2684	0,6195
7Y	-0,0240	5	-4	0,0895	0,4396	0,7527
10Y	0,2360	6	-4	0,3360	0,6317	0,8883
15Y	0,5550	8	-4	0,6059	0,8130	0,9908
20Y	0,7240	8	-4	0,7414	0,8821	0,9870
30Y	0,8000	9	-5	0,7812	0,8608	0,9203

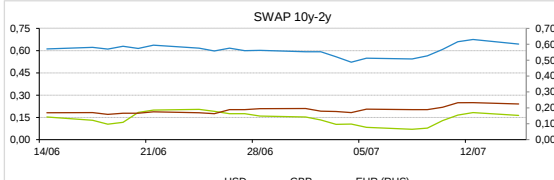
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,0690	6	-11	1,7083	1,7880	2,0592
2Y	1,8860	0	-3	1,7058	1,8590	2,1020
3Y	1,8400	0	-2	1,7180	1,9040	2,1430
4Y	1,8280	13	1	1,7595	1,9737	2,1880
5Y	1,8630	1	-1	1,8130	2,0369	2,2512
7Y	1,9410	2	-1	1,9200	2,1333	2,2870
10Y	2,0680	3	-1	2,0690	2,2314	2,3450
15Y	2,2090	3	-2	2,1991	2,2910	2,3780
20Y	2,2780	3	-1	2,2350	2,3180	2,4065
30Y	2,3130	4	-1	2,2575	2,3135	2,3490

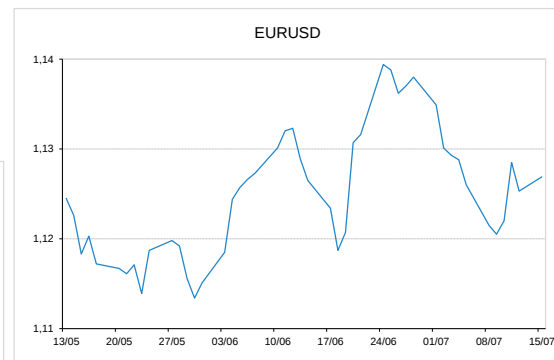
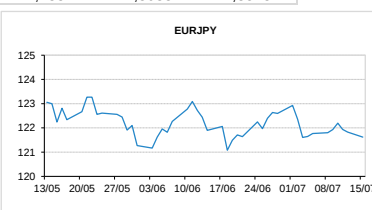
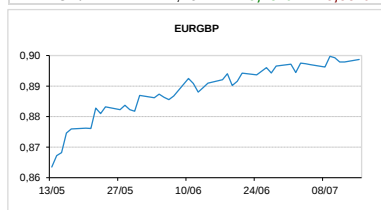


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	66,45	-0,27	5,44	OT 2Y	-0,459	-0,02	-14,40
JETFUEL	646,92	-5,83	56,83	OT 5Y	-0,112	-0,04	-5,30
DIESEL	609,17	-4,83	52,83	OT 10Y	0,586	-0,07	-5,60
COBRE	5.960,00	-20,00	83,00	BUND 10Y	-0,887	-4,61	-5,60
ZINCO	2.447,75	11,75	-111,75	SCHATZ 2Y	-0,114	-0,69	-5,70
OURO	1.412,57	1,18	65,38	T-NOTE 10Y	2,857	-0,63	1,90
TRIGO	511,75	-11,25	-30,25	T-NOTE 2Y	2,216	0,00	7,50
LICENÇA C02	28,91	0,12	3,86	GILT 10Y	0,794	-3,13	-3,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1269	0,14%	0,31%	1,1351	1,1433	1,1577
EUR/GBP	0,89873	-0,09%	-0,74%	0,9015	0,9047	0,9108
EUR/JPY	121,62	0,17%	0,36%	121,62	121,62	121,62
EUR/CHF	1,1087	0,05%	1,12%	1,1076	1,1063	1,1042
EUR/BRL	4,2221	-0,20%	3,32%	4,2890	4,3508	4,4725
EUR/PLN	4,2617	0,19%	0,00%	4,2834	4,3083	4,3573



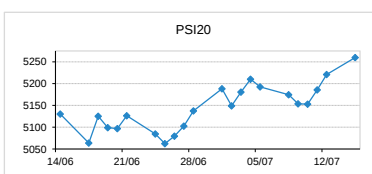
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1269	0,8987	121,62	1,1087	10,5372	7,4673	1,4679	1,60015	4,2221	9,6195
USD	0,8880	-	0,799	107,975	0,9848	9,3653	6,6307	1,3044	1,4228	3,7500	8,5401

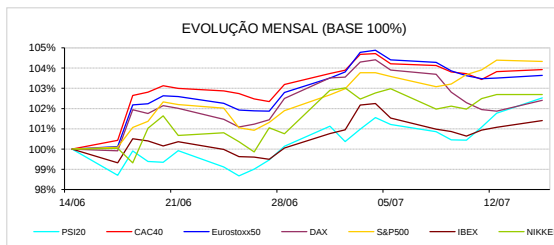
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,025	0,84	3,88
BCP	0,286	0,49	24,44
CORT. AMORIM	9,900	-0,20	10,00
CTT	2,056	0,88	-30,21
EDP	3,378	-0,12	10,79
EDP R	9,100	0,00	17,04
GALP	14,045	0,68	1,81
IBERSOL	8,100	-0,74	2,53
J MARTINS	14,920	1,77	44,29
MOTA ENGIL	1,950	0,93	21,12
NAVIGATOR	3,238	1,06	-10,06
NOS	5,830	1,39	10,10
NOVABASE	2,350	1,29	16,34
PHAROL	0,152	0,53	-6,86
RAMADA	7,020	-0,28	-6,40
REN	12,360	0,32	-5,65
SEMAPA	0,733	0,14	-13,66
SONAE CAP.	0,892	1,94	10,06
SONAE SGPS	7,020	-0,28	-6,40

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE CAP.	1,94
J MARTINS	1,77
NOS	1,39
NOVABASE	1,29
NAVIGATOR	1,06
EDP	-0,12
CORT. AMORIM	-0,20
RAMADA	-0,28
RAMADA	-0,28
IBERSOL	-0,74



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.260,02	0,74%	11,17%	5.660,82	4.551,84
CAC40	5.578,21	0,10%	17,92%	5.629,79	4.555,99
ESTX 50 PR	3.502,22	0,13%	16,69%	3.549,26	2.908,70
XTRA DAX	12.387,34	0,52%	17,32%	12.886,83	10.279,20
S&P 500	3.011,77	-0,06%	20,15%	3.017,80	2.346,58
IBEX 35	9.323,60	0,33%	9,18%	9.924,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.685,90	0,20%	8,35%	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.