

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

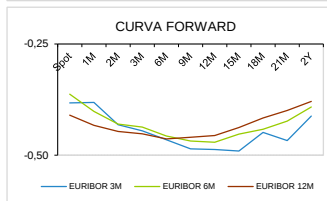
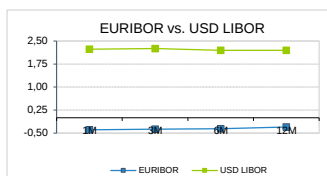
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

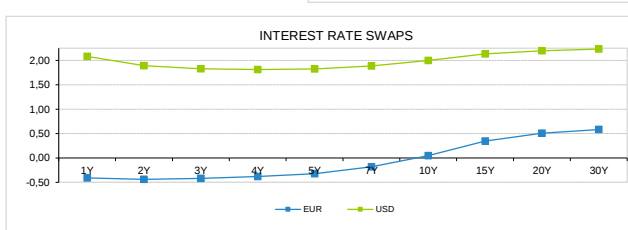
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3920	0	0	1M	2,2344	0	-16	0,7143	-0,8090
3M	-0,3740	-1	-3	3M	2,2555	-1	-6	0,7776	-0,7596
6M	-0,3550	0	-4	6M	2,1963	-1	0	0,8100	-0,7356
12M	-0,3010	1	-9	12M	2,1980	0	2	0,8568	-0,6212

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4091	0	-4	-0,4557	-0,2520	0,0770
2Y	-0,4390	1	-6	-0,4171	-0,1691	0,1630
3Y	-0,4200	1	-8	-0,3629	-0,0870	0,2510
4Y	-0,3800	0	-9	-0,2935	-0,0007	0,3340
5Y	-0,3220	0	-11	-0,2187	0,0860	0,4070
7Y	-0,1820	-1	-12	-0,0594	0,2450	0,5380
10Y	0,0470	-2	-14	0,1686	0,4341	0,6760
15Y	0,3460	-3	-15	0,4305	0,6195	0,7870
20Y	0,5080	-3	-15	0,5670	0,6937	0,7964
30Y	0,5830	-3	-14	0,6123	0,6820	0,7403

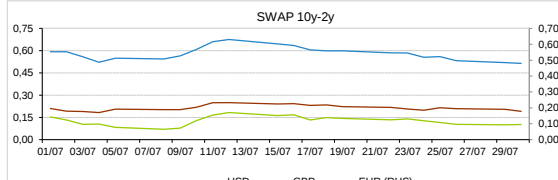
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,0840	1	9	1,7003	1,7585	1,9976
2Y	1,8940	2	12	1,6976	1,8101	2,0095
3Y	1,8280	1	11	1,7123	1,8540	2,0745
4Y	1,8140	1	10	1,7500	1,9090	2,1341
5Y	1,8240	1	8	1,7952	1,9620	2,1783
7Y	1,8870	0	6	1,8922	2,0355	2,2095
10Y	1,9990	0	4	2,0189	2,1335	2,2635
15Y	2,1330	0	3	2,1185	2,2180	2,3065
20Y	2,1990	0	3	2,1840	2,2495	2,3090
30Y	2,2330	0	2	2,2070	2,2530	2,2870

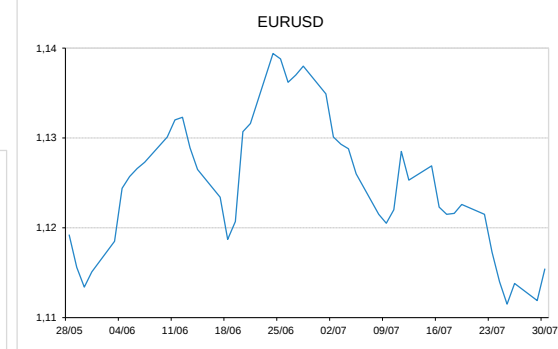
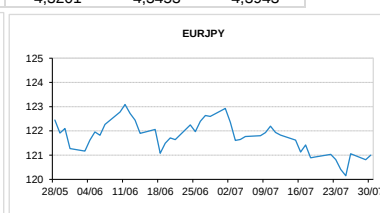
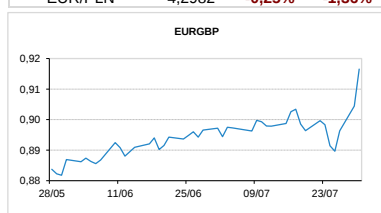


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,13	0,42	-0,61	OT 2Y	-0,545	0,01	-12,40
JETFUEL	639,25	9,25	-0,25	OT 5Y	-0,229	0,00	-6,00
DIESEL	596,75	6,50	-3,75	OT 10Y	0,406	-0,02	-7,00
COBRE	6.015,00	55,00	25,00	BUND 10Y	-1,036	-0,27	-11,90
ZINCO	2.474,50	35,50	-32,50	SCHATZ 2Y	-0,133	0,23	-0,20
OURO	1.428,42	7,73	18,82	T-NOTE 10Y	2,851	2,19	7,40
TRIGO	497,50	-6,00	-29,75	T-NOTE 2Y	2,262	1,15	15,70
LICENÇA C02	27,86	-0,56	1,58	GILT 10Y	0,628	-1,41	-20,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1154	0,31%	-1,72%	1,1236	1,1323	1,1470
EUR/GBP	0,91653	-1,32%	-2,11%	0,9193	0,9225	0,9284
EUR/JPY	121	-0,16%	1,60%	121,00	121,00	121,00
EUR/CHF	1,1046	0,06%	0,95%	1,1033	1,1019	1,0998
EUR/BRL	4,2257	-0,25%	2,62%	4,2883	4,3479	4,4685
EUR/PLN	4,2982	-0,25%	-1,36%	4,3201	4,3453	4,3943



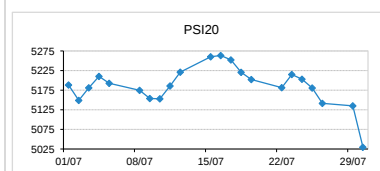
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1154	0,9165	121,00	1,1046	10,6686	7,4678	1,4685	1,62245	4,2257	9,7629
USD	0,8977	-	0,8229	108,645	0,9913	9,5723	6,7040	1,3180	1,4550	3,7925	8,7643

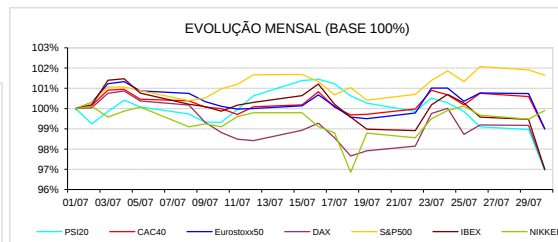
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,060	-0,57	4,48
BCP	0,236	-5,99	2,61
CORT. AMORIM	9,740	0,41	8,22
CTT	1,926	-3,70	-34,62
EDP	3,313	-2,01	8,66
EDP R	9,210	-1,50	18,46
GALP	14,010	-0,99	1,56
IBERSOL	8,060	0,00	2,03
J MARTINS	14,615	-0,75	41,34
MOTA ENGIL	1,816	-3,46	12,80
NAVIGATOR	3,086	-2,22	-14,28
NOS	5,690	-1,30	7,46
NOVABASE	2,640	-1,12	30,69
PHAROL	0,147	-2,65	-9,93
RAMADA	6,540	-2,39	-12,80
REN	12,120	-1,14	-7,48
SEMAPA	0,703	-1,13	-17,20
SONAE CAP.	0,838	-2,05	3,40
SONAE SGPS	6,540	-2,39	-12,80

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	0,41
RAMADA	-2,39
PHAROL	-2,65
MOTA ENGIL	-3,46
CTT	-3,70
BCP	-5,99



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.029,67	-2,05%	6,30%	5.651,42	4.551,84
CAC40	5.511,07	-1,61%	16,50%	5.672,77	4.555,99
ESTX 50 PR	3.462,91	-1,72%	15,38%	3.573,57	2.908,70
XTRA DAX	12.147,24	-2,18%	15,04%	12.860,59	10.279,20
S&P 500	3.013,07	-0,26%	20,20%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	8.985,70	-2,49%	5,22%	9.924,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.709,31	0,43%	8,47%	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.