

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

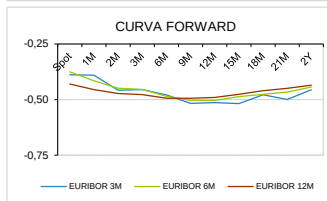
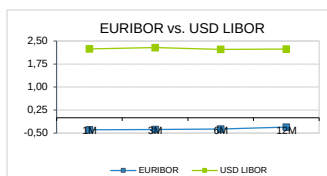
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

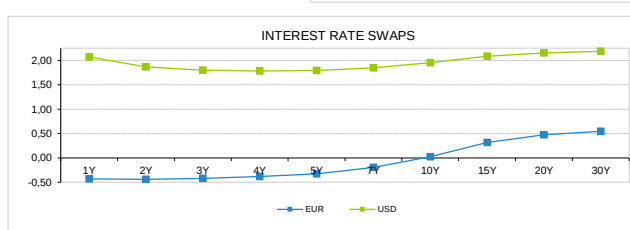
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3920	0	-1	1M	2,2441	2	-14	0,7115	-0,8138
3M	-0,3800	0	-3	3M	2,2868	2	-5	0,7700	-0,7700
6M	-0,3670	0	-4	6M	2,2269	2	1	0,8118	-0,7466
12M	-0,3040	0	-7	12M	2,2385	5	4	0,8470	-0,6330

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4298	-1	-5	-0,4950	-0,3347	-0,0557
2Y	-0,4380	-1	-6	-0,4673	-0,2677	0,0200
3Y	-0,4200	0	-7	-0,4230	-0,1967	0,0980
4Y	-0,3810	-1	-8	-0,3673	-0,1232	0,1740
5Y	-0,3270	-1	-10	-0,3048	-0,0474	0,2370
7Y	-0,1940	-1	-12	-0,1673	0,0945	0,3477
10Y	0,0260	-2	-15	0,0307	0,2591	0,4694
15Y	0,3160	-2	-18	0,2604	0,4210	0,5641
20Y	0,4760	-2	-18	0,3762	0,4820	0,5675
30Y	0,5470	-3	-18	0,4044	0,4605	0,5028

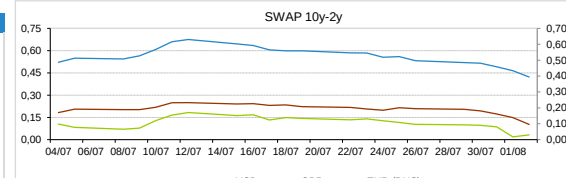
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,00
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,0710	-1	6	1,5433	1,5532	1,7350
2Y	1,8660	-2	7	1,5290	1,5785	1,7870
3Y	1,8010	-2	7	1,5160	1,6492	1,8551
4Y	1,7840	-2	5	1,5420	1,6760	1,8800
5Y	1,7930	-2	4	1,5800	1,7245	1,9456
7Y	1,8490	-2	1	1,6635	1,8120	1,9915
10Y	1,9550	-3	0	1,7850	1,9245	2,0793
15Y	2,0860	-3	-2	1,9170	2,0165	2,1070
20Y	2,1530	-3	-2	1,9805	2,0520	2,1348
30Y	2,1880	-3	-2	2,0025	2,0535	2,0770

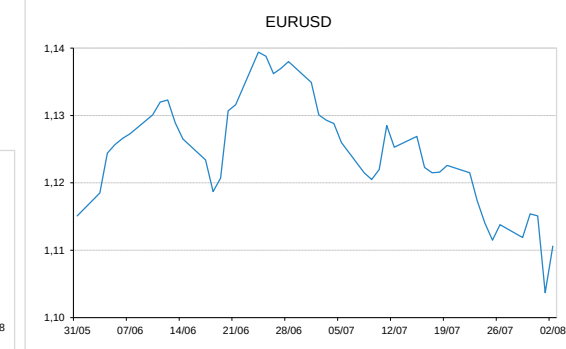
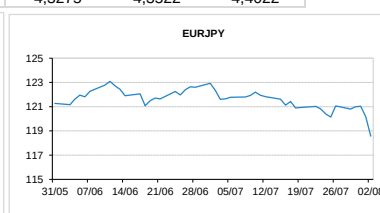
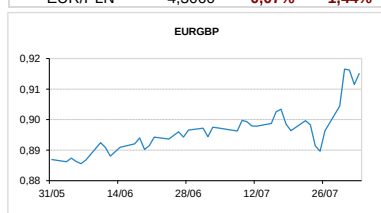


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,07	1,57	-0,09	OT 2Y	-0,552	-0,01	-5,40
JETFUEL	616,25	-9,69	-4,82	OT 5Y	-0,245	0,00	4,90
DIESEL	583,25	-8,19	0,51	OT 10Y	0,293	-0,05	-0,10
COBRE	5,865,00	-28,00	-55,50	BUND 10Y	-1,131	-3,17	-15,10
ZINCO	2,403,00	-42,50	-70,00	SCHATZ 2Y	-0,153	-0,69	-1,30
OURO	1,445,77	26,68	40,65	T-NOTE 10Y	2,691	-1,54	-5,90
TRIGO	483,00	7,25	-20,25	T-NOTE 2Y	2,139	0,38	0,90
LICENÇA C02	29,23	-0,22	2,51	GILT 10Y	0,538	-3,67	-14,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1106	0,63%	-1,73%	1,1185	1,1265	1,1405
EUR/GBP	0,91505	-0,39%	-2,25%	0,9179	0,9210	0,9270
EUR/JPY	118,57	1,36%	3,20%	118,57	118,57	118,57
EUR/CHF	1,0913	0,66%	2,03%	1,0901	1,0886	1,0862
EUR/BRL	4,3107	-1,23%	0,72%	4,3736	4,4319	4,5505
EUR/PLN	4,3060	-0,07%	-1,44%	4,3275	4,3522	4,4022



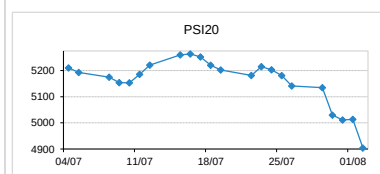
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1106	0,9151	118,57	1,0913	10,7100	7,4666	1,4687	1,63311	4,3107	9,9069
USD	0,9008	-	0,8253	106,565	0,9832	9,6494	6,7258	1,3237	1,4717	3,8882	8,9266

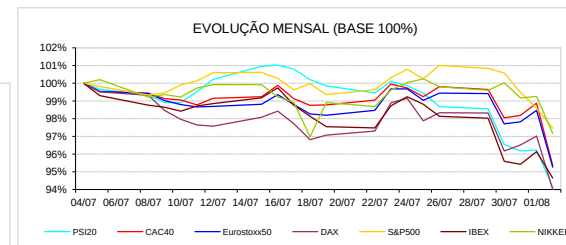
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,485	-3,52	-5,43
BCP	0,222	-3,56	-3,18
CORT. AMORIM	9,590	-0,42	6,56
CTT	1,892	-1,87	-35,78
EDP	3,323	-0,95	8,99
EDP R	9,410	0,32	21,03
GALP	13,450	-4,03	-2,50
IBERSOL	8,060	-2,18	2,03
J MARTINS	14,170	-3,90	37,04
MOTA ENGIL	1,738	-4,77	7,95
NAVIGATOR	2,898	-3,59	-19,50
NOS	5,600	-0,88	5,76
NOVABASE	2,600	-1,89	28,71
PHAROL	0,147	-1,60	-9,68
RAMADA	6,280	1,95	-16,27
REN	11,900	-0,50	-9,16
SEMAPA	0,686	-2,28	-19,20
SONAE CAP.	0,824	-2,31	1,73
SONAE SGPS	6,280	1,95	-16,27

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
RAMADA	1,95
RAMADA	1,95
EDP R	0,32
BCP	-3,56
NAVIGATOR	-3,59
J MARTINS	-3,90
GALP	-4,03
MOTA ENGIL	-4,77



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4,903,80	-2,19%	3,64%	5,651,42	4,551,84
CAC40	5,359,00	-3,57%	13,28%	5,672,77	4,555,99
ESTX 50 PR	3,376,12	-3,26%	12,48%	3,573,57	2,908,70
XTRA DAX	11,872,44	-3,11%	12,44%	12,738,53	10,279,20
S&P 500	2,919,70	-1,14%	16,47%	3,027,98	2,346,58
IBEX 35	8,897,60	-1,56%	4,19%	9,813,60	8,286,20
NIKKEI 225	21,087,16	-2,11%	5,36%	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.