

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

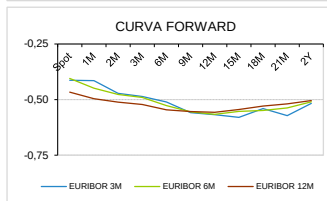
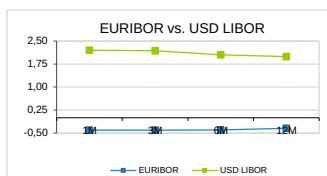
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

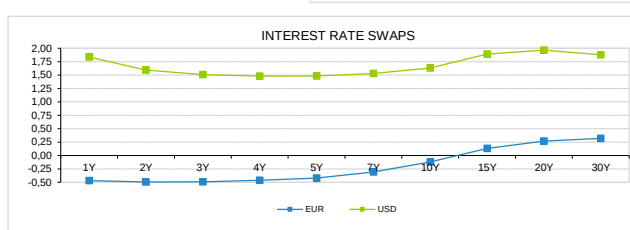
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4030	1	-1	1M	2,2009	-1	-18	0,7040	-0,8216
3M	-0,4040	-1	-5	3M	2,1810	0	-16	0,7696	-0,7874
6M	-0,3960	0	-6	6M	2,0503	0	-21	0,8004	-0,7746
12M	-0,3430	0	-9	12M	1,9930	2	-27	0,8361	-0,6666

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4661	-1	-9	-0,5571	-0,3896	-0,1127
2Y	-0,4930	0	-9	-0,5306	-0,3267	-0,0339
3Y	-0,4900	-1	-11	-0,4865	-0,2535	0,0461
4Y	-0,4620	0	-13	-0,4301	-0,1796	0,1206
5Y	-0,4200	0	-15	-0,3662	-0,1022	0,1910
7Y	-0,3080	0	-18	-0,2250	0,0408	0,2975
10Y	-0,1190	1	-22	-0,0233	0,2088	0,4187
15Y	0,1310	3	-27	0,2074	0,3702	0,5133
20Y	0,2680	4	-29	0,3239	0,4329	0,5184
30Y	0,3200	4	-31	0,3544	0,4103	0,4511

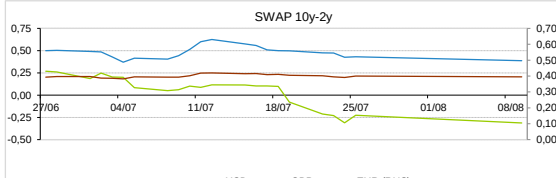
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,00
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,8350	-13	-17	1,3780	1,3340	1,5275
2Y	1,5930	-14	-20	1,3496	1,3915	1,5831
3Y	1,5090	-15	-21	1,3545	1,4360	1,6275
4Y	1,4810	-14	-22	1,3400	1,4655	1,6687
5Y	1,4820	-14	-23	1,3740	1,5364	1,7108
7Y	1,5300	-13	-25	1,4807	1,6030	1,7420
10Y	1,6320	-13	-27	1,5745	1,7630	1,8292
15Y	1,8930	-12	-21	1,6780	1,7770	1,8759
20Y	1,9650	-11	-22	1,7625	1,8090	1,8807
30Y	1,8770	-13	-28	1,7730	1,8222	1,8265

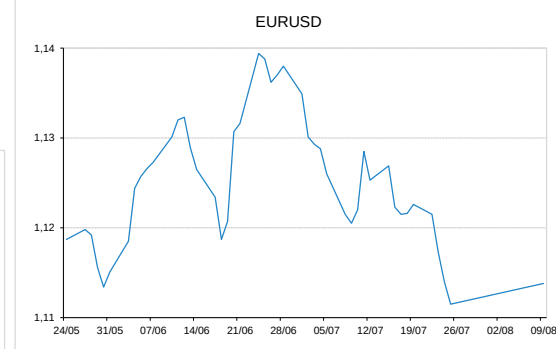
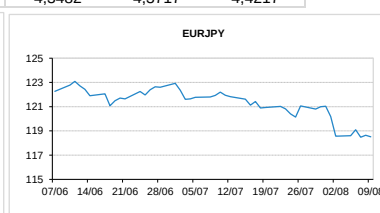
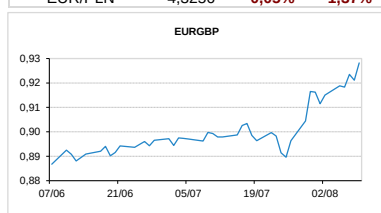


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	58,56	1,18	-5,37	OT 2Y	-0,577	0,02	-14,00
JETFUEL	584,39	8,26	-35,53	OT 5Y	-0,213	0,02	-7,00
DIESEL	550,39	8,51	-34,78	OT 10Y	0,288	0,04	-3,80
COBRE	5.780,00	93,00	-94,00	BUND 10Y	-1,218	-1,87	-11,70
ZINCO	2.302,25	44,25	-73,25	SCHATZ 2Y	-0,231	-1,37	-11,90
OURO	1.503,26	7,55	106,35	T-NOTE 10Y	2,575	-1,07	-25,50
TRIGO	499,50	1,00	-3,25	T-NOTE 2Y	2,030	-0,76	-16,90
LICENÇA C02	28,14	-0,39	1,58	GILT 10Y	0,468	-5,47	-13,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1198	0,04%	-0,06%	1,1276	1,1353	1,1486
EUR/GBP	0,9282	-0,76%	-3,07%	0,9312	0,9344	0,9405
EUR/JPY	118,51	0,11%	2,89%	118,51	118,51	118,51
EUR/CHF	1,0898	0,33%	2,14%	1,0885	1,0869	1,0845
EUR/BRL	4,4223	-0,93%	-3,68%	4,4857	4,5456	4,6713
EUR/PLN	4,3256	-0,05%	-1,37%	4,3482	4,3717	4,4217



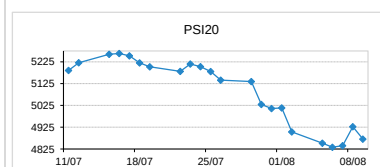
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1198	0,9282	118,51	1,0898	10,6969	7,4632	1,4839	1,64991	4,4223	9,9565
USD	0,8929	-	0,8279	105,665	0,9740	9,5505	6,6634	1,3241	1,4700	3,9399	8,8808

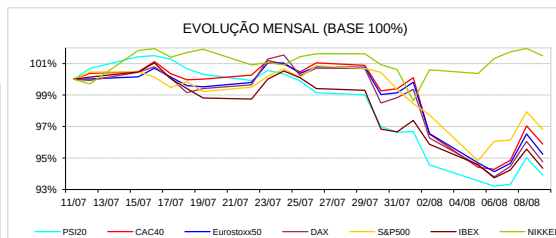
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,500	-1,96	-5,17
BCP	0,212	-3,46	-7,71
CORT. AMORIM	9,090	-1,73	1,00
CTT	1,865	-2,00	-36,69
EDP	3,369	0,21	10,50
EDP R	9,690	0,62	24,63
GALP	13,115	-1,02	-4,93
IBERSOL	8,300	1,47	5,06
J MARTINS	14,490	-1,70	40,14
MOTA ENGIL	1,718	-1,38	6,71
NAVIGATOR	2,864	-0,83	-20,44
NOS	5,515	-0,99	4,15
NOVABASE	2,650	1,15	31,19
PHAROL	0,145	-0,69	-11,40
RAMADA	6,120	0,33	-18,40
REN	11,620	-3,01	-11,30
SEMAPA	0,649	1,25	-23,56
SONAE CAP.	0,809	-1,46	-0,19
SONAE SGPS	6,120	0,33	-18,40

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	1,47
SEMAPA	1,25
NOVABASE	1,15
EDP R	0,62
RAMADA	0,33
CORT. AMORIM	-1,73
ALTRI	-1,96
CTT	-2,00
REN	-3,01
BCP	-3,46



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.870,81	-1,14%	2,94%	5.644,37	4.551,84
CAC40	5.323,31	-1,20%	12,53%	5.672,77	4.555,99
ESTX 50 PR	3.330,14	-1,34%	10,95%	3.573,57	2.908,70
XTRA DAX	11.686,39	-1,34%	10,68%	12.696,52	10.279,20
S&P 500	2.904,72	-1,14%	15,87%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	8.755,60	-1,28%	2,53%	9.756,70	8.286,20
NIKKEI 225	20.684,82	0,44%	3,35%	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.