

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

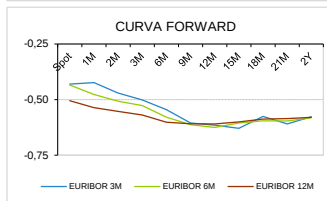
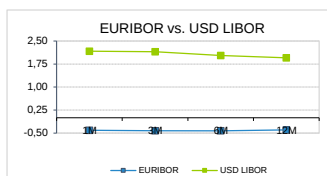
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

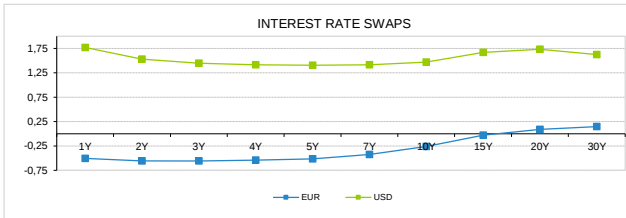
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4050	0	0	1M	2,1686	0	-9	0,7108	-0,8456
3M	-0,4210	0	-5	3M	2,1515	2	-11	0,7654	-0,8398
6M	-0,4250	0	-7	6M	2,0291	1	-12	0,8098	-0,8142
12M	-0,3950	0	-9	12M	1,9533	1	-20	0,8678	-0,7196

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5050	-1	-8	-0,6098	-0,5174	-0,3037
2Y	-0,5550	0	-11	-0,5946	-0,4716	-0,2362
3Y	-0,5580	1	-14	-0,5677	-0,4155	-0,1634
4Y	-0,5420	1	-18	-0,5317	-0,3531	-0,0949
5Y	-0,5140	2	-22	-0,4853	-0,2861	-0,0330
7Y	-0,4250	4	-28	-0,3721	-0,1582	0,0729
10Y	-0,2600	6	-37	-0,1977	-0,0011	0,1909
15Y	-0,0300	8	-46	0,0139	0,1476	0,2697
20Y	0,0910	9	-51	0,1126	0,2028	0,2811
30Y	0,1470	10	-53	0,1457	0,1877	0,2207

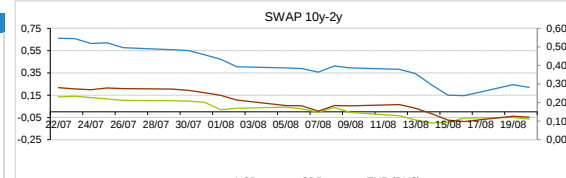
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,00
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7700	-7	-28	1,2705	1,2375	1,3910
2Y	1,5310	0	-37	1,2310	1,2740	1,4329
3Y	1,4480	-12	-41	1,2330	1,3140	1,4623
4Y	1,4160	-11	-43	1,2535	1,3425	1,5020
5Y	1,4050	-11	-47	1,2912	1,3904	1,5350
7Y	1,4160	-5	-53	1,3290	1,4350	1,5876
10Y	1,4710	-12	-59	1,4280	1,5155	1,6140
15Y	1,6690	-9	-54	1,5220	1,6070	1,6951
20Y	1,7320	-10	-55	1,5740	1,6370	1,6840
30Y	1,6250	-14	-67	1,6126	1,6460	1,6730

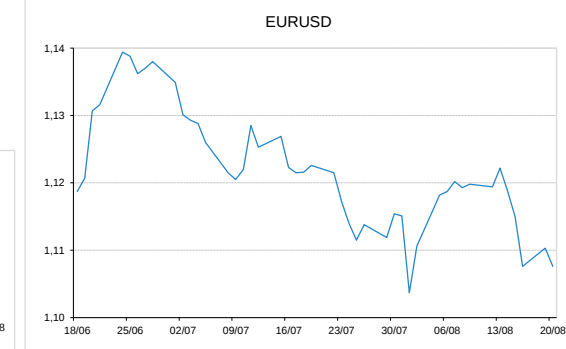
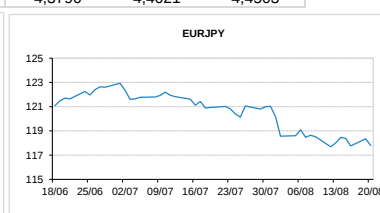


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	59,43	-0,31	-2,85	OT 2Y	-0,590	-0,01	-7,40
JETFUEL	600,35	1,10	-20,40	OT 5Y	-0,307	-0,03	-7,80
DIESEL	565,35	0,10	-14,90	OT 10Y	0,123	-0,04	-33,60
COBRE	5.769,00	30,00	-291,00	BUND 10Y	-1,329	-4,83	-36,70
ZINCO	2.260,00	-0,50	-167,50	SCHATZ 2Y	-0,263	-0,46	-12,10
OURO	1.503,53	1,62	77,52	T-NOTE 10Y	2,499	-3,63	-32,20
TRIGO	464,00	-8,50	-49,50	T-NOTE 2Y	1,969	-3,43	-23,00
LICENÇA C02	26,15	-0,41	-2,74	GILT 10Y	0,451	-2,42	-27,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1076	-0,24%	-1,24%	1,1151	1,1227	1,1357
EUR/GBP	0,91623	-0,04%	-1,81%	0,9192	0,9224	0,9290
EUR/JPY	117,79	0,47%	2,75%	117,79	117,79	117,79
EUR/CHF	1,0864	0,12%	1,34%	1,0850	1,0833	1,0809
EUR/BRL	4,4834	0,68%	-6,49%	4,5451	4,6064	4,7317
EUR/PLN	4,3565	0,22%	-2,50%	4,3790	4,4021	4,4503



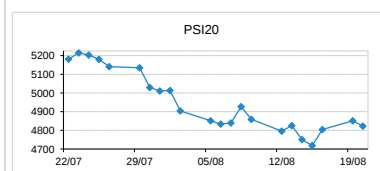
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1076	0,9162	117,79	1,0864	10,7702	7,4557	1,4790	1,6362	4,4834	9,9869
USD	0,9018	-	0,8244	106,325	0,9791	9,7063	6,7236	1,3320	1,4745	4,0315	9,0043

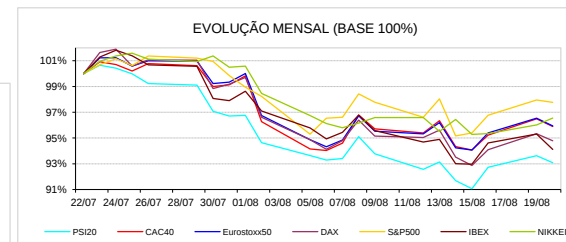
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,500	-1,96	-5,17
BCP	0,202	-0,74	-11,90
CORT. AMORIM	9,020	0,22	0,22
CTT	1,829	-2,04	-37,92
EDP	3,357	-0,33	10,10
EDP R	9,590	1,05	23,34
GALP	12,585	-0,91	-8,77
IBERSOL	8,200	0,99	3,80
J MARTINS	14,615	-0,65	41,34
MOTA ENGIL	1,897	0,90	17,83
NAVIGATOR	2,946	-1,41	-18,17
NOS	5,415	-1,63	2,27
NOVABASE	2,680	-0,74	32,67
PHAROL	0,116	-3,17	-28,80
RAMADA	6,240	1,96	-16,80
REN	12,000	-0,33	-8,40
SEMAPA	0,620	-0,16	-26,97
SONAE CAP.	0,820	0,00	1,23
SONAE SGPS	6,240	1,96	-16,80

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
RAMADA	1,96
RAMADA	1,96
EDP R	1,05
IBERSOL	0,99
MOTA ENGIL	0,90
NAVIGATOR	-1,41
NOS	-1,63
ALTRI	-1,96
CTT	-2,04
PHAROL	-3,17



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.822,58	-0,59%	1,93%	5.543,73	4.551,84
CAC40	5.338,51	-0,62%	12,85%	5.672,77	4.555,99
ESTX 50 PR	3.348,30	-0,62%	11,56%	3.573,57	2.908,70
XTRA DAX	11.647,97	-0,58%	10,31%	12.656,05	10.279,20
S&P 500	2.918,50	-0,18%	16,42%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	8.624,30	-1,25%	0,99%	9.671,10	8.286,20
NIKKEI 225	20.677,22	0,55%	3,31%	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.