

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

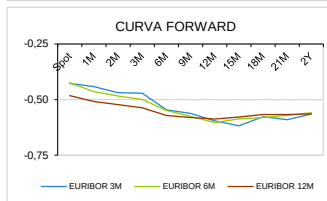
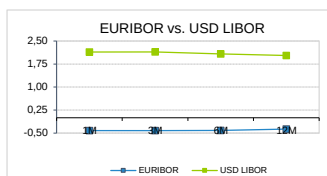
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

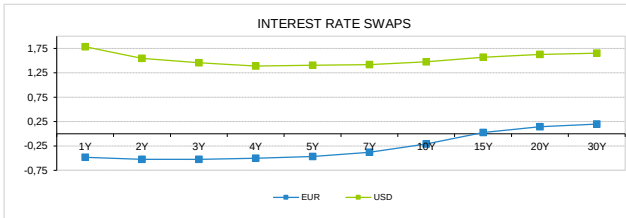
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4160	1	-2	1M	2,1395	-1	-13	0,7090	-0,8568
3M	-0,4180	0	-5	3M	2,1444	1	-13	0,7620	-0,8422
6M	-0,4150	0	-5	6M	2,0801	4	-10	0,8055	-0,8214
12M	-0,3690	-1	-6	12M	2,0285	6	-16	0,8663	-0,7170

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4818	1	-7	-0,5903	-0,4954	-0,3027
2Y	-0,5230	-2	-8	-0,5757	-0,4505	-0,2396
3Y	-0,5250	-3	-10	-0,5487	-0,4010	-0,1696
4Y	-0,5020	-3	-12	-0,5123	-0,3446	-0,1030
5Y	-0,4680	-2	-15	-0,4701	-0,2815	-0,0420
7Y	-0,3800	-3	-21	-0,3644	-0,1569	0,0577
10Y	-0,2100	-4	-27	-0,1961	-0,0147	0,1674
15Y	0,0240	-4	-35	-0,0042	0,1206	0,2413
20Y	0,1440	-5	-39	0,0900	0,1737	0,2494
30Y	0,1980	-5	-42	0,1196	0,1584	0,1939

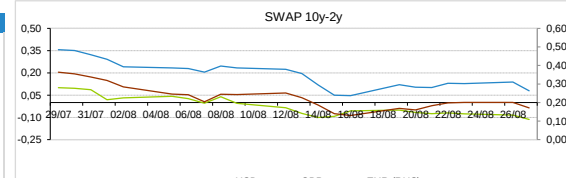
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,00
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7850	2	-23	1,2819	1,1710	1,3185
2Y	1,5450	3	-28	1,1895	1,2100	1,3490
3Y	1,4560	3	-32	1,1820	1,2415	1,3825
4Y	1,3890	-4	-46	1,1980	1,2755	1,4150
5Y	1,4050	3	-38	1,2250	1,3090	1,4698
7Y	1,4190	3	-44	1,2780	1,3790	1,5095
10Y	1,4770	2	-50	1,3670	1,4605	1,5605
15Y	1,5690	2	-55	1,4776	1,5430	1,6100
20Y	1,6260	1	-56	1,5280	1,5755	1,6306
30Y	1,6540	1	-57	1,5450	1,5715	1,5950

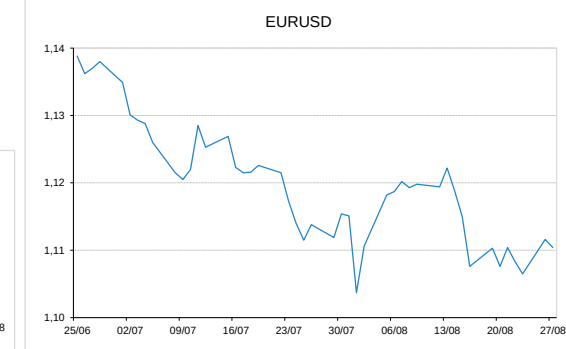
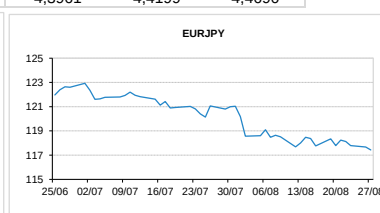


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	58,77	0,07	-4,60	OT 2Y	-0,610	-0,03	-5,20
JETFUEL	596,75	0,00	-30,25	OT 5Y	-0,329	0,03	-10,80
DIESEL	559,00	0,00	-29,50	OT 10Y	0,111	-0,06	-32,80
COBRE	5.634,50	-50,00	-335,00	BUND 10Y	-1,329	-2,76	-31,50
ZINCO	2.259,50	7,50	-180,50	SCHATZ 2Y	-0,240	0,46	-11,90
OURO	1.541,60	12,43	122,92	T-NOTE 10Y	2,461	-4,08	-39,10
TRIGO	476,25	1,00	-28,00	T-NOTE 2Y	2,011	-1,72	-25,90
LICENÇA C02	25,43	-0,40	-2,86	GILT 10Y	0,422	-6,83	-25,50



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1104	-0,11%	-0,13%	1,1180	1,1256	1,1388
EUR/GBP	0,90435	0,41%	0,01%	0,9073	0,9104	0,9167
EUR/JPY	117,43	0,20%	2,88%	117,43	117,43	117,43
EUR/CHF	1,0888	-0,04%	1,52%	1,0874	1,0858	1,0830
EUR/BRL	4,6283	-0,32%	-8,94%	4,6902	4,7507	4,8807
EUR/PLN	4,3728	-0,31%	-1,95%	4,3961	4,4199	4,4690



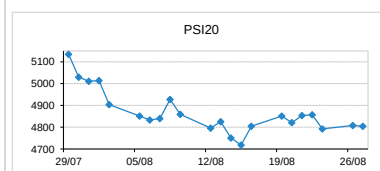
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1104	0,9044	117,43	1,0888	10,7140	7,4569	1,4726	1,64133	4,6283	10,064
USD	0,9009	-	0,8148	105,935	0,9818	9,6561	6,7181	1,3262	1,4792	4,1648	9,0194

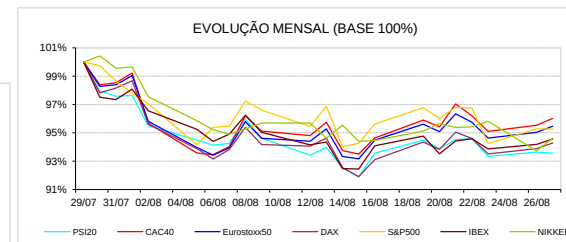
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,665	2,26	-2,33
BCP	0,204	-0,92	-11,07
CORT. AMORIM	9,140	2,24	1,56
CTT	1,945	0,99	-33,98
EDP	3,374	0,39	10,66
EDP R	9,480	-0,73	21,93
GALP	12,525	-0,16	-9,21
IBERSOL	8,180	0,99	3,54
J MARTINS	14,335	-1,04	38,64
MOTA ENGIL	1,903	-1,14	18,20
NAVIGATOR	3,018	-0,33	-16,17
NOS	5,180	-0,19	-2,17
NOVABASE	2,870	0,00	42,08
PHAROL	0,111	-1,07	-32,11
RAMADA	6,380	0,95	-14,93
REN	12,120	1,00	-7,48
SEMAPA	0,619	0,16	-27,09
SONAE CAP.	0,818	-0,91	0,93
SONAE SGPS	6,380	0,95	-14,93

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	2,26
CORT. AMORIM	2,24
REN	1,00
IBERSOL	0,99
CTT	0,99
SONAE CAP.	-0,91
BCP	-0,92
J MARTINS	-1,04
PHAROL	-1,07
MOTA ENGIL	-1,14



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.804,31	-0,08%	1,54%	5.543,73	4.551,84
CAC40	5.378,44	0,51%	13,69%	5.672,77	4.555,99
ESTX 50 PR	3.363,91	0,45%	12,08%	3.573,57	2.908,70
XTRA DAX	11.708,35	0,43%	10,89%	12.656,05	10.279,20
S&P 500	2.878,48	-0,01%	14,81%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	8.713,80	0,40%	2,04%	9.671,10	8.286,20
NIKKEI 225	20.456,08	0,96%	2,20%	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.