

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

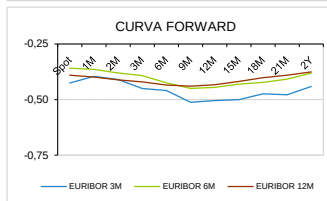
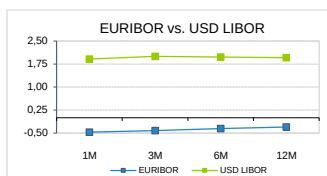
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

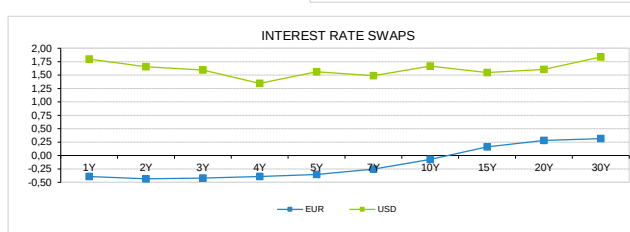
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4680	1	-3	1M	1,9135	-1	-12	0,7164	-0,8020
3M	-0,4160	0	-2	3M	2,0009	1	-13	0,7848	-0,7868
6M	-0,3530	1	2	6M	1,9756	4	-8	0,8514	-0,7180
12M	-0,3010	0	2	12M	1,9555	6	-5	0,9414	-0,5924

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3907	1	1	-0,4332	-0,2795	-0,0385
2Y	-0,4340	2	7	-0,4058	-0,2274	0,0320
3Y	-0,4210	3	8	-0,3649	-0,1645	0,1118
4Y	-0,3910	3	9	-0,3166	-0,0960	0,1842
5Y	-0,3520	3	9	-0,2608	-0,0226	0,2438
7Y	-0,2530	4	7	-0,1313	0,1157	0,3628
10Y	-0,0740	4	4	0,0610	0,2751	0,4827
15Y	0,1610	4	0	0,2769	0,4247	0,5557
20Y	0,2800	4	-2	0,3791	0,4732	0,5569
30Y	0,3150	4	-4	0,3960	0,4430	0,4773

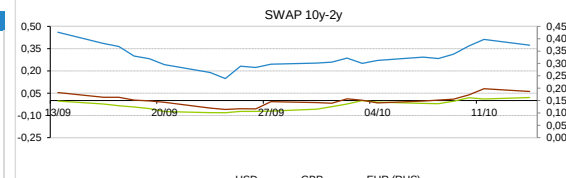
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7990	8	-6	1,5246	1,4665	1,6007
2Y	1,6560	10	1	1,4712	1,5077	1,6485
3Y	1,5930	10	3	1,4696	1,5397	1,7623
4Y	1,3450	-1	-3	1,4891	1,5847	1,7228
5Y	1,5620	11	5	1,5146	1,6139	1,8115
7Y	1,4880	13	3	1,5722	1,6888	1,8095
10Y	1,6660	10	6	1,6648	1,7583	1,8562
15Y	1,5480	-8	9	1,7544	1,8241	1,8896
20Y	1,6040	-7	9	1,8014	1,8510	1,8985
30Y	1,8370	8	5	1,8207	1,8472	1,8706

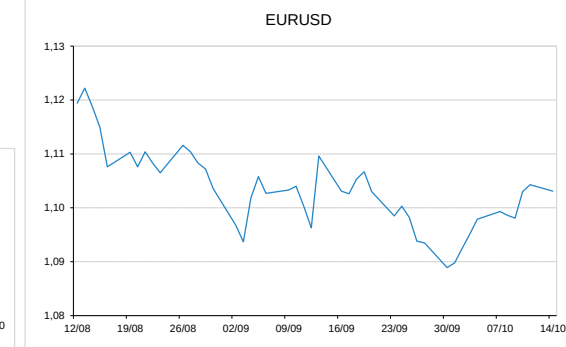
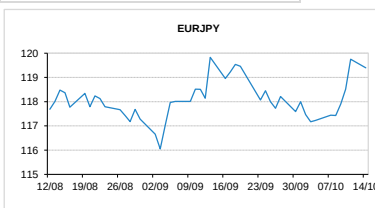
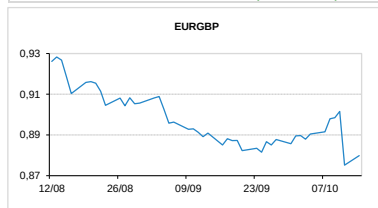


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	59,12	-1,39	-0,13	OT 2Y	-0,584	-0,01	-0,70
JETFUEL	618,25	-6,32	-14,83	OT 5Y	-0,239	-0,02	-1,60
DIESEL	586,25	-6,32	-14,33	OT 10Y	0,172	-0,03	-6,30
COBRE	5.803,00	15,00	23,50	BUND 10Y	-0,899	-0,96	9,60
ZINCO	2.456,50	28,25	93,00	SCHATZ 2Y	-0,082	2,06	3,90
OURO	1.492,15	7,13	1,85	T-NOTE 10Y	2,559	-3,05	-7,20
TRIGO	508,75	0,75	25,25	T-NOTE 2Y	2,034	-1,72	-8,40
LICENÇA C02	24,13	-0,31	-2,25	GILT 10Y	0,633	-6,89	-0,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1031	-0,11%	0,00%	1,1103	1,1166	1,1292
EUR/GBP	0,87983	-0,53%	0,60%	0,8828	0,8856	0,8916
EUR/JPY	119,4	0,29%	-0,37%	119,40	119,40	119,40
EUR/CHF	1,0996	0,09%	-0,71%	1,0984	1,0974	1,0956
EUR/BRL	4,5587	-0,48%	-1,55%	4,6057	4,6468	4,7473
EUR/PLN	4,2933	0,25%	0,81%	4,3173	4,3408	4,3907



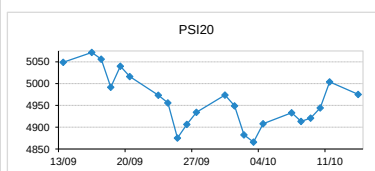
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1031	0,8798	119,40	1,0996	10,8268	7,4694	1,4583	1,62864	4,5587	10,0489
USD	0,9070	-	0,7947	108,405	0,9964	9,8190	6,7746	1,3225	1,4781	4,1253	9,1097

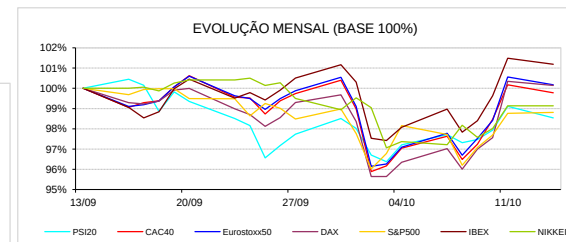
ACCIONISTA

TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,365	-1,83	-7,50
BCP	0,192	-1,59	-16,17
CORT. AMORIM	9,740	-0,61	8,22
CTT	2,206	-0,63	-25,12
EDP	3,579	-0,69	17,38
EDP R	9,850	-0,20	26,69
GALP	13,565	-0,48	-1,67
IBERSOL	7,880	-1,99	-0,25
J MARTINS	14,980	-1,12	44,87
MOTA ENGIL	1,879	-0,69	16,71
NAVIGATOR	3,256	-1,93	-9,56
NOS	5,260	0,77	-0,66
NOVABASE	2,490	-3,11	23,27
PHAROL	0,103	-1,90	-36,89
RAMADA	6,180	1,31	-17,60
REN	12,340	0,33	-5,80
SEMAPA	0,660	5,26	-22,26
SONAE CAP.	0,888	0,85	9,63
SONAE SGPS	6,180	1,31	-17,60

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SEMAPA	5,26
RAMADA	1,31
RAMADA	1,31
SONAE CAP.	0,85
NOS	0,77
ALTRI	-1,83
PHAROL	-1,90
NAVIGATOR	-1,93
IBERSOL	-1,99
NOVABASE	-3,11



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.975,17	-0,58%	5,15%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.643,08	-0,40%	19,29%	5.704,93	4.555,99
ESTX 50 PR	3.556,26	-0,38%	18,49%	3.588,68	2.908,70
XTRA DAX	12.486,56	-0,20%	18,26%	12.656,05	10.279,20
S&P 500	2.971,54	0,04%	18,53%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	9.246,50	-0,29%	8,27%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	21.798,87	1,15%	8,91%	22.959,41	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.