

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

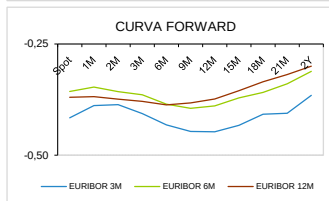
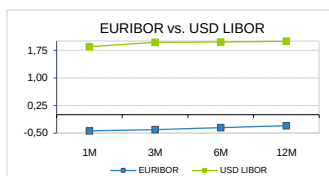
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

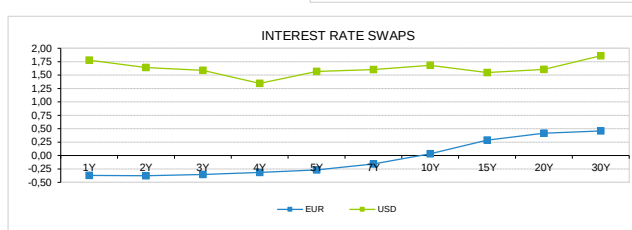
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,4380	1	0	1M	1,8464	-3	-21	0,7145
3M	-0,4070	0	-1	3M	1,9659	-4	-20	0,7931
6M	-0,3510	0	2	6M	1,9745	-1	-11	0,8846
12M	-0,2980	0	1	12M	1,9931	0	-7	0,9848

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3708	0	4	-0,3759	-0,2030	0,0326
2Y	-0,3770	2	5	-0,3395	-0,1414	0,1165
3Y	-0,3540	3	7	-0,2940	-0,0840	0,1856
4Y	-0,3150	3	9	-0,2413	-0,0112	0,2613
5Y	-0,2690	4	10	-0,1863	0,0545	0,3250
7Y	-0,1570	4	11	-0,0579	0,1939	0,4426
10Y	0,0330	4	10	0,1335	0,3561	0,5619
15Y	0,2880	5	9	0,3580	0,5101	0,6433
20Y	0,4160	5	8	0,4615	0,5610	0,6398
30Y	0,4580	6	7	0,4793	0,5282	0,5614

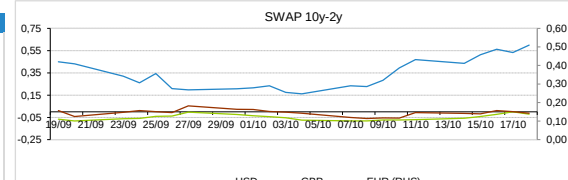
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7790	-2	-16	1,4785	1,4934	1,6180
2Y	1,6400	-2	-12	1,4610	1,5075	1,6600
3Y	1,5880	-2	-10	1,4610	1,5450	1,7020
4Y	1,3450	-1	-3	1,4780	1,6024	1,7420
5Y	1,5680	-1	-8	1,5050	1,6400	1,8002
7Y	1,6010	0	-7	1,5730	1,6990	1,8210
10Y	1,6810	0	-6	1,6720	1,7973	1,8923
15Y	1,5480	-8	9	1,7871	1,8691	1,9421
20Y	1,6040	-7	9	1,8395	1,8954	1,9459
30Y	1,8600	1	-5	1,8470	1,8916	1,9080

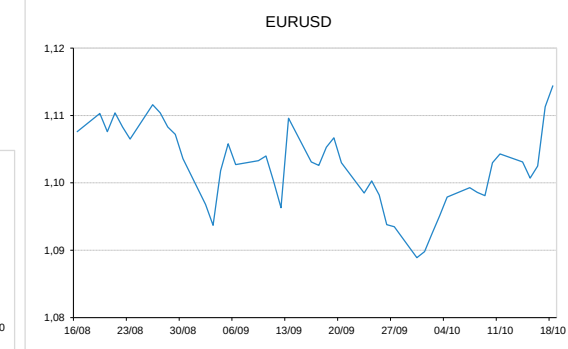
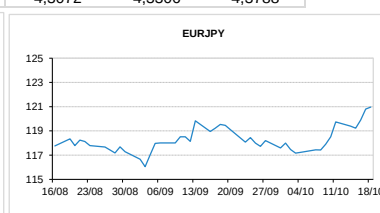


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	59,55	-0,36	-3,11	OT 2Y	-0,567	0,00	-4,20
JETFUEL	631,61	1,87	20,61	OT 5Y	-0,218	0,02	2,80
DIESEL	595,67	0,42	-25,25	OT 10Y	0,199	0,02	-4,20
COBRE	5.749,00	9,00	-82,00	BUND 10Y	-0,832	1,10	12,50
ZINCO	2.475,00	5,50	123,00	SCHATZ 2Y	-0,048	-0,46	12,10
OURO	1.491,47	-3,30	-17,15	T-NOTE 10Y	2,567	-1,98	-7,00
TRIGO	528,00	2,50	38,50	T-NOTE 2Y	1,998	-4,01	-12,00
LICENÇA C02	25,99	-0,07	0,54	GILT 10Y	0,702	1,15	5,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1144	0,28%	0,82%	1,1217	1,1280	1,1402
EUR/GBP	0,86435	0,47%	2,64%	0,8673	0,8702	0,8762
EUR/JPY	120,97	-0,13%	-1,18%	120,97	120,97	120,97
EUR/CHF	1,0992	-0,08%	0,11%	1,0981	1,0971	1,0953
EUR/BRL	4,6077	0,58%	-1,60%	4,6551	4,6958	4,8079
EUR/PLN	4,2831	-0,05%	1,30%	4,3072	4,3306	4,3788



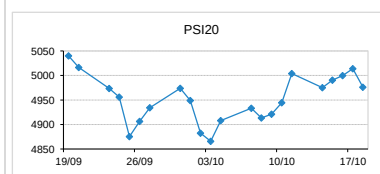
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1144	0,8644	120,97	1,0992	10,7861	7,4713	1,4654	1,62897	4,6077	10,2358
USD	0,8978	-	0,7753	108,515	0,9866	9,6704	6,7070	1,3134	1,4602	4,1309	9,1752

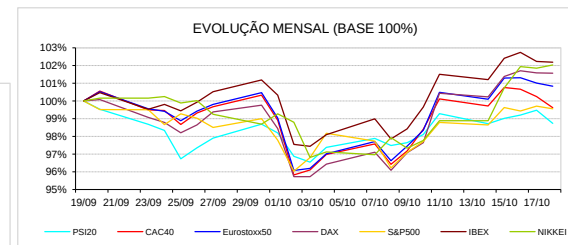
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,355	-0,46	-7,67
BCP	0,194	-1,97	-15,34
CORT. AMORIM	9,840	-0,61	9,33
CTT	2,350	1,03	-20,23
EDP	3,517	-0,23	15,35
EDP R	9,730	-0,31	25,14
GALP	13,530	-0,15	-1,92
IBERSOL	7,520	3,58	-4,81
J MARTINS	14,955	-1,48	44,63
MOTA ENGL	1,935	-2,62	20,19
NAVIGATOR	3,270	-0,85	-9,17
NOS	5,275	-1,03	-0,38
NOVABASE	2,450	-0,81	21,29
PHAROL	0,102	-0,58	-37,38
RAMADA	6,240	2,30	-16,80
REN	12,580	0,48	-3,97
SEMAPA	0,686	0,15	-19,20
SONAE CAP.	0,903	-1,15	11,42
SONAE SGPS	6,240	2,30	-16,80

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	3,58
RAMADA	2,30
RAMADA	2,30
CTT	1,03
REN	0,48
NOS	-1,03
SONAE CAP.	-1,15
J MARTINS	-1,48
BCP	-1,97
MOTA ENGL	-2,62



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.976,13	-0,75%	5,17%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.637,37	-0,63%	19,17%	5.737,15	4.555,99
ESTX 50 PR	3.582,38	-0,17%	19,36%	3.630,43	2.908,70
XTRA DAX	12.652,72	-0,02%	19,83%	12.814,49	10.279,20
S&P 500	2.993,62	-0,15%	19,41%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	9.336,10	-0,04%	9,32%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	22.492,68	0,18%	12,38%	22.873,13	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.