

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

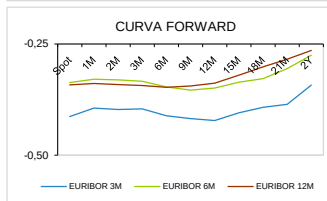
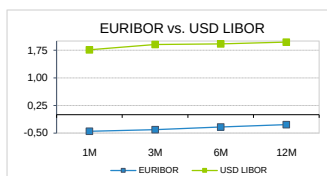
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

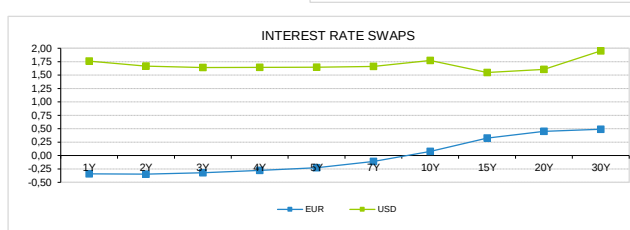
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4500	1	1	1M	1,7625	0	-13	0,7120	-0,7428
3M	-0,4040	-1	1	3M	1,9041	-1	-10	0,7889	-0,7070
6M	-0,3330	0	3	6M	1,9216	0	-6	0,8584	-0,6496
12M	-0,2690	0	3	12M	1,9711	-2	0	0,9550	-0,5180

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3415	0	4	-0,3382	-0,1544	0,1082
2Y	-0,3470	-1	8	-0,3045	-0,0902	0,1810
3Y	-0,3200	-1	9	-0,2495	-0,0243	0,2518
4Y	-0,2770	-1	10	-0,1934	0,0450	0,3192
5Y	-0,2270	-2	11	-0,1347	0,1157	0,3824
7Y	-0,1110	-2	12	-0,0035	0,2451	0,4858
10Y	0,0750	-2	12	0,1824	0,4036	0,6045
15Y	0,3260	-3	12	0,4009	0,5534	0,6847
20Y	0,4520	-3	12	0,5030	0,6008	0,6768
30Y	0,4900	-3	12	0,5127	0,5605	0,5918

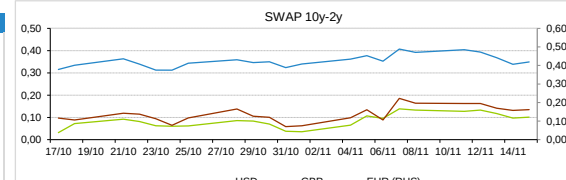
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,00
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7600	-2	-4	1,5139	1,5370	1,7100
2Y	1,6660	-4	1	1,5065	1,6123	1,7480
3Y	1,6410	-5	5	1,5451	1,6130	1,7680
4Y	1,6430	6	11	1,5692	1,6520	1,8394
5Y	1,6470	-6	9	1,5986	1,6860	1,8766
7Y	1,6610	-3	31	1,6320	1,7770	1,8925
10Y	1,7730	-7	11	1,7470	1,8350	1,9734
15Y	1,5480	-8	9	1,8270	1,9155	1,9730
20Y	1,6040	-7	9	1,8770	1,9280	1,9760
30Y	1,9510	-7	11	1,8920	1,9570	1,9450

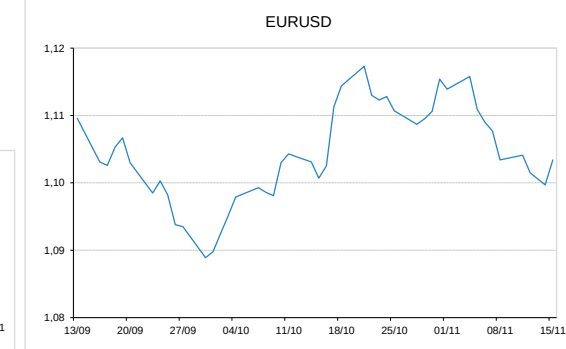
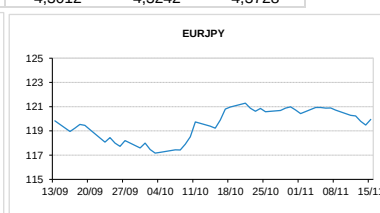


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	63,37	1,09	4,83	OT 2Y	-0,467	-0,01	11,00
JETFUEL	627,01	7,11	3,25	OT 5Y	-0,111	-0,03	10,20
DIESEL	592,50	7,50	2,00	OT 10Y	0,369	-0,01	16,50
COBRE	5.801,00	-23,00	-6,00	BUND 10Y	-0,781	1,25	5,30
ZINCO	2.432,00	-24,00	-15,00	SCHATZ 2Y	-0,007	0,92	5,00
OURO	1.465,14	-7,28	-15,66	T-NOTE 10Y	2,662	1,99	8,30
TRIGO	506,00	-5,00	-7,25	T-NOTE 2Y	2,093	1,91	6,70
LICENÇA C02	23,80	-0,16	-1,91	GILT 10Y	0,714	1,68	3,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1034	0,34%	0,25%	1,1102	1,1164	1,1286
EUR/GBP	0,8566	-0,02%	1,63%	0,8594	0,8621	0,8678
EUR/JPY	119,95	-0,38%	-0,60%	119,95	119,95	119,95
EUR/CHF	1,0939	-0,46%	0,64%	1,0929	1,0921	1,0904
EUR/BRL	4,6164	-0,39%	-1,43%	4,6582	4,6961	4,8084
EUR/PLN	4,2764	0,25%	0,34%	4,3012	4,3242	4,3728



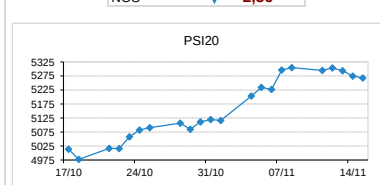
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1034	0,8566	119,95	1,0939	10,6547	7,4727	1,4617	1,62209	4,6164	10,0365
USD	0,9049	-	0,7751	108,725	0,9895	9,6346	6,7619	1,3224	1,4679	4,1880	9,0766

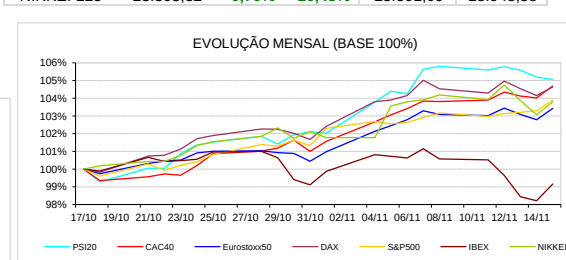
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,070	1,93	4,66
BCP	0,209	-0,38	-8,85
CORT. AMORIM	10,080	0,00	12,00
CTT	3,130	0,00	6,25
EDP	3,711	0,38	21,71
EDP R	10,200	0,79	31,19
GALP	15,185	0,43	10,08
IBERSOL	7,460	-0,27	-5,57
J MARTINS	14,850	-0,83	43,62
MOTA ENGIL	2,078	0,87	29,07
NAVIGATOR	3,624	1,74	0,67
NOS	5,140	-2,56	-2,93
NOVABASE	2,850	-0,70	41,09
PHAROL	0,115	1,94	-29,29
RAMADA	6,280	0,32	-16,27
REN	14,080	0,14	7,48
SEMAPA	0,803	-0,74	-5,42
SONAE CAP.	0,927	0,11	14,44
SONAE SGPS	6,280	0,32	-16,27

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	1,94
ALTRI	1,93
NAVIGATOR	1,74
MOTA ENGIL	0,87
EDP R	0,79
BCP	-0,38
NOVABASE	-0,70
SEMAPA	-0,74
J MARTINS	-0,83
NOS	-2,56



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.267,66	-0,13%	11,33%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.939,27	0,65%	25,55%	5.947,62	4.555,99
ESTX 50 PR	3.711,61	0,62%	23,66%	3.719,40	2.908,70
XTRA DAX	13.241,75	0,47%	25,41%	13.308,26	10.279,20
S&P 500	3.114,91	0,59%	24,25%	3.116,02	2.346,58
IBEX 35	9.261,40	0,96%	8,45%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	23.303,32	0,70%	16,43%	23.591,09	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.