

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

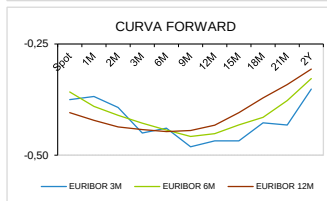
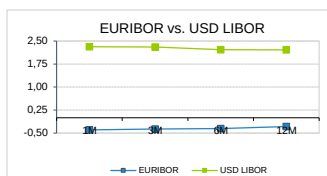
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

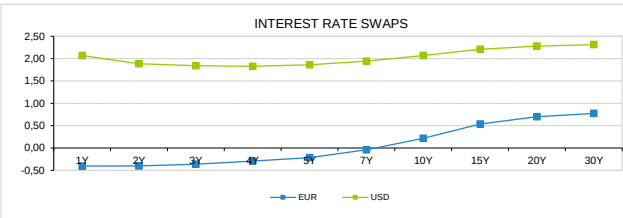
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3950	0	-2	1M	2,3141	-2	-7	0,7200	-0,8098
3M	-0,3670	0	-5	3M	2,3033	-2	-10	0,7671	-0,7466
6M	-0,3500	-1	-9	6M	2,2171	-1	-6	0,8118	-0,7126
12M	-0,2860	0	-12	12M	2,2105	-2	-4	0,8935	-0,5966

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4032	-1	-10	-0,4333	-0,1225	0,2580
2Y	-0,4010	-1	-7	-0,3691	-0,0270	0,3470
3Y	-0,3620	-1	-6	-0,2866	0,0680	0,4380
4Y	-0,2940	-1	-5	-0,1970	0,1600	0,5250
5Y	-0,2140	-2	-4	-0,1060	0,2520	0,5970
7Y	-0,0410	-2	-3	0,0759	0,4190	0,7290
10Y	0,2170	-2	-3	0,3207	0,6163	0,8650
15Y	0,5340	-2	-3	0,5931	0,7999	0,9700
20Y	0,7000	-2	-3	0,7280	0,8682	0,9720
30Y	0,7730	-3	-3	0,7669	0,8457	0,8997

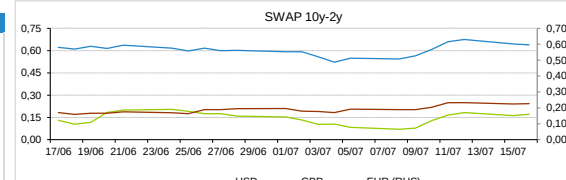
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,0690	6	-11	1,7374	1,8395	2,0620
2Y	1,8860	0	-3	1,7250	1,8870	2,1220
3Y	1,8400	0	-2	1,7620	1,9460	2,1460
4Y	1,8280	13	1	1,8060	2,0010	2,2200
5Y	1,8630	1	-1	1,8540	2,0550	2,2833
7Y	1,9410	2	-1	1,9769	2,1701	2,2920
10Y	2,0680	3	-1	2,0860	2,2420	2,3445
15Y	2,2090	3	-2	2,2306	2,3407	2,4333
20Y	2,2780	3	-1	2,2883	2,3460	2,4090
30Y	2,3130	4	-1	2,2920	2,3400	2,3951

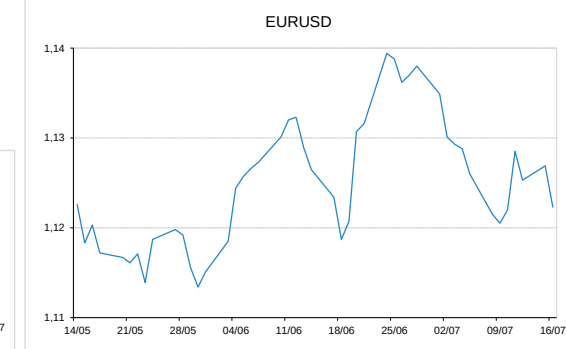
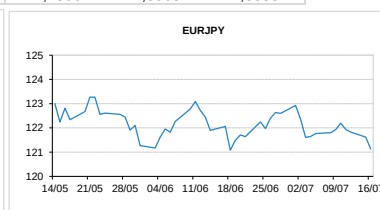
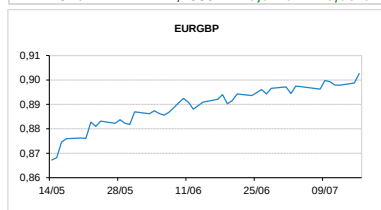


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	66,66	0,18	5,65	OT 2Y	-0,479	-0,02	-15,90
JETFUEL	643,50	2,62	39,25	OT 5Y	-0,146	-0,03	-8,80
DIESEL	605,00	2,12	35,75	OT 10Y	0,552	-0,03	-5,80
COBRE	5.998,50	48,00	161,00	BUND 10Y	-0,886	0,14	-3,60
ZINCO	2.448,00	8,25	-18,00	SCHATZ 2Y	-0,115	-0,23	-4,10
OURO	1.404,10	-8,98	56,91	T-NOTE 10Y	2,898	4,08	5,40
TRIGO	506,00	-1,75	-36,00	T-NOTE 2Y	2,254	4,22	8,60
LICENÇA C02	28,44	-0,61	3,39	GILT 10Y	0,812	2,50	-2,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1223	-0,41%	-0,10%	1,1304	1,1390	1,1534
EUR/GBP	0,9026	-0,43%	-1,17%	0,9054	0,9087	0,9148
EUR/JPY	121,13	0,40%	0,77%	121,13	121,13	121,13
EUR/CHF	1,1086	0,01%	1,13%	1,1074	1,1061	1,1040
EUR/BRL	4,2149	0,36%	3,48%	4,2822	4,3439	4,4661
EUR/PLN	4,2589	0,04%	0,06%	4,2806	4,3065	4,3555



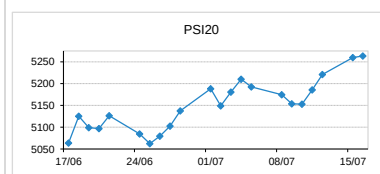
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1223	0,9026	121,13	1,1086	10,5227	7,4672	1,4634	1,59803	4,2149	9,5979
USD	0,8911	-	0,8053	108,265	0,9876	9,3742	6,6544	1,3031	1,4226	3,7603	8,5440

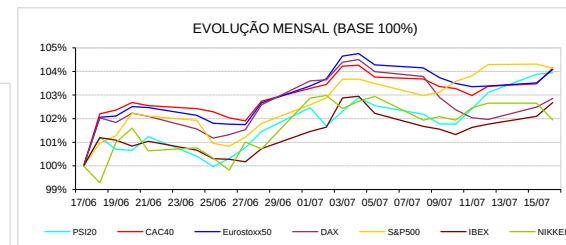
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,040	0,25	4,14
BCP	0,289	1,16	25,88
CORT. AMORIM	9,880	-0,20	9,78
CTT	2,060	0,19	-30,07
EDP	3,370	-0,24	10,53
EDP R	9,130	0,33	17,43
GALP	14,005	-0,28	1,52
IBERSOL	8,100	0,00	2,53
J MARTINS	14,875	-0,30	43,86
MOTA ENGIL	1,963	0,67	21,93
NAVIGATOR	3,240	0,06	-10,00
NOS	5,760	-1,20	8,78
NOVABASE	2,370	0,85	17,33
PHAROL	0,158	3,82	-3,31
RAMADA	7,000	-0,28	-6,67
REN	12,420	0,49	-5,19
SEMAPA	0,727	-0,82	-14,37
SONAE CAP.	0,905	1,46	11,67
SONAE SGPS	7,000	-0,28	-6,67

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	3,82
SONAE CAP.	1,46
BCP	1,16
NOVABASE	0,85
MOTA ENGIL	0,67
RAMADA	-0,28
RAMADA	-0,28
J MARTINS	-0,30
SEMAPA	-0,82
NOS	-1,20



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.263,54	0,07%	11,25%	5.660,82	4.551,84
CAC40	5.614,38	0,65%	18,68%	5.629,79	4.555,99
ESTX 50 PR	3.521,36	0,55%	17,32%	3.549,26	2.908,70
XTRA DAX	12.430,97	0,35%	17,73%	12.886,83	10.279,20
S&P 500	3.009,21	-0,17%	20,04%	3.017,80	2.346,58
IBEX 35	9.377,10	0,57%	9,80%	9.924,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.535,25	-0,69%	7,60%	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.