

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

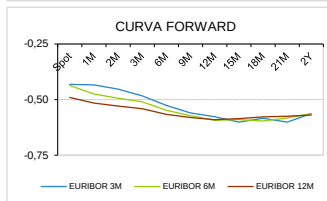
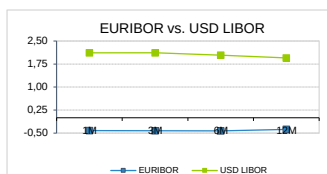
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

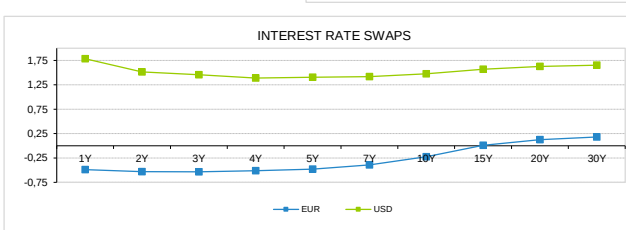
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4170	0	-2	1M	2,1159	-2	-12	0,7094	-0,8566
3M	-0,4220	0	-5	3M	2,1174	-3	-15	0,7646	-0,8452
6M	-0,4270	-1	-7	6M	2,0375	-4	-17	0,7931	-0,8340
12M	-0,3790	-1	-7	12M	1,9494	-8	-25	0,8514	-0,7382

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4900	-1	-8	-0,5889	-0,5260	-0,3515
2Y	-0,5300	-1	-9	-0,5813	-0,4883	-0,2879
3Y	-0,5340	-1	-11	-0,5621	-0,4425	-0,2205
4Y	-0,5110	-1	-13	-0,5342	-0,3876	-0,1537
5Y	-0,4780	-1	-16	-0,4976	-0,3273	-0,0980
7Y	-0,3920	-1	-22	-0,3983	-0,2082	-0,0074
10Y	-0,2250	-2	-29	-0,2414	-0,0723	0,0944
15Y	0,0080	-2	-36	-0,0584	0,0559	0,1611
20Y	0,1240	-2	-41	0,0242	0,0987	0,1632
30Y	0,1800	-2	-43	0,0436	0,0782	0,1055

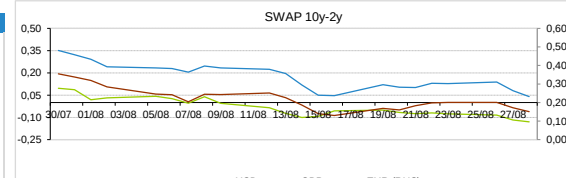
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,00
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7850	2	-23	1,2437	1,1345	1,2850
2Y	1,5130	-3	-38	1,1680	1,1795	1,3130
3Y	1,4560	3	-32	1,1768	1,2160	1,3440
4Y	1,3890	-4	-46	1,1856	1,2470	1,3770
5Y	1,4050	3	-38	1,1970	1,2780	1,4261
7Y	1,4190	3	-44	1,2460	1,3450	1,4635
10Y	1,4770	2	-50	1,3320	1,4210	1,4945
15Y	1,5690	2	-55	1,4290	1,4980	1,5670
20Y	1,6260	1	-56	1,4830	1,5300	1,5740
30Y	1,6540	1	-57	1,5200	1,5310	1,5495

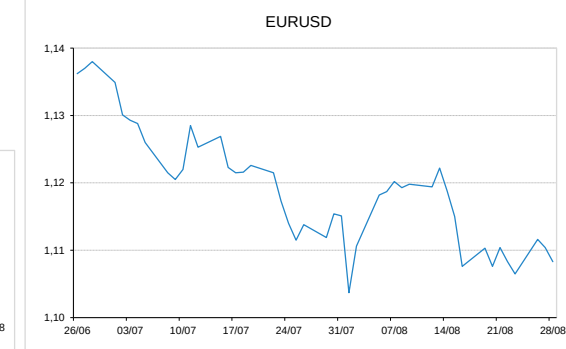
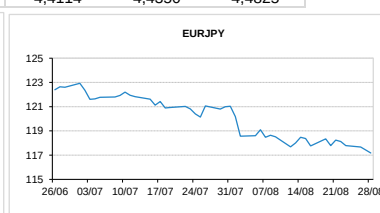


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	60,65	1,14	-2,72	OT 2Y	-0,609	0,00	-5,20
JETFUEL	596,25	-0,50	-30,75	OT 5Y	-0,351	-0,02	-12,30
DIESEL	558,50	-0,50	-30,00	OT 10Y	0,094	-0,02	-32,70
COBRE	5.678,00	50,00	-280,00	BUND 10Y	-1,352	-2,36	-32,10
ZINCO	2.281,75	22,25	-159,25	SCHATZ 2Y	-0,240	0,00	-10,50
OURO	1.536,94	-5,92	118,26	T-NOTE 10Y	2,450	-1,66	-37,90
TRIGO	471,50	-5,25	-32,75	T-NOTE 2Y	1,992	-1,91	-25,80
LICENÇA C02	25,91	0,50	-2,38	GILT 10Y	0,363	-5,50	-27,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1083	-0,19%	-0,32%	1,1159	1,1234	1,1365
EUR/GBP	0,90823	-0,43%	-0,42%	0,9112	0,9143	0,9205
EUR/JPY	117,18	0,21%	3,10%	117,18	117,18	117,18
EUR/CHF	1,0872	0,04%	1,65%	1,0858	1,0842	1,0814
EUR/BRL	4,6059	-0,48%	-8,48%	4,6689	4,7315	4,8665
EUR/PLN	4,3884	-0,29%	-2,30%	4,4114	4,4350	4,4825



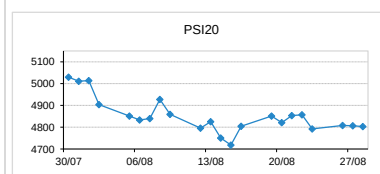
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1083	0,9082	117,18	1,0872	10,7738	7,4565	1,4738	1,64283	4,6059	10,0113
USD	0,9029	-	0,8184	105,915	0,9814	9,7227	6,7326	1,3298	1,4833	4,1544	9,0404

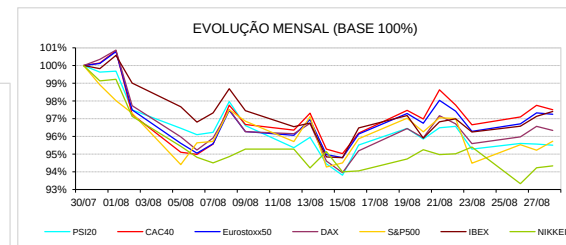
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,585	-1,15	-3,36
BCP	0,195	-4,45	-14,86
CORT. AMORIM	9,120	-0,22	1,33
CTT	1,941	-0,21	-34,11
EDP	3,370	0,00	10,53
EDP R	9,660	1,90	24,24
GALP	12,760	1,84	-7,50
IBERSOL	8,180	0,00	3,54
J MARTINS	14,630	2,31	41,49
MOTA ENGIL	1,881	-1,62	16,83
NAVIGATOR	2,992	-1,32	-16,89
NOS	5,195	-0,10	-2,36
NOVABASE	2,870	0,00	42,08
PHAROL	0,106	-4,68	-35,05
RAMADA	6,300	-1,25	-16,00
REN	12,000	-1,32	-8,40
SEMAPA	0,619	0,00	-27,09
SONAE CAP.	0,814	-0,61	0,49
SONAE SGPS	6,300	-1,25	-16,00

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
J MARTINS	2,31
EDP R	1,90
GALP	1,84
REN	-1,32
NAVIGATOR	-1,32
MOTA ENGIL	-1,62
BCP	-4,45
PHAROL	-4,68



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.799,14	-0,07%	1,52%	5.543,73	4.551,84
CAC40	5.371,89	-0,25%	13,59%	5.672,77	4.555,99
ESTX 50 PR	3.366,42	-0,08%	12,20%	3.573,57	2.908,70
XTRA DAX	11.700,25	-0,24%	10,83%	12.656,05	10.279,20
S&P 500	2.884,02	0,52%	15,05%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	8.753,70	0,28%	2,50%	9.671,10	8.286,20
NIKKEI 225	20.479,42	0,11%	2,32%	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.