

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

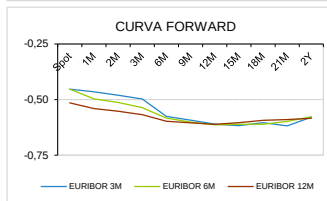
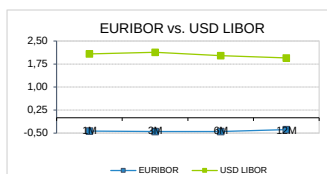
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

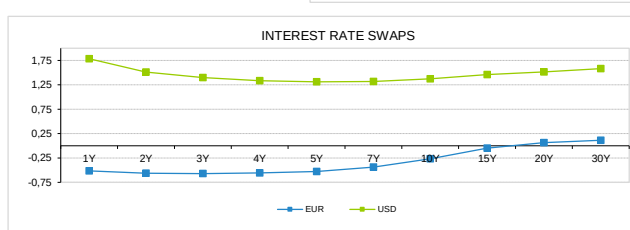
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4350	-1	-4	1M	2,0819	-1	-15	0,7081	-0,8886
3M	-0,4480	-1	-7	3M	2,1328	0	-11	0,7668	-0,8548
6M	-0,4480	-1	-8	6M	2,0240	-1	-11	0,7835	-0,8492
12M	-0,3850	0	-8	12M	1,9494	-2	-17	0,8321	-0,7498

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5143	0	-8	-0,6172	-0,5247	-0,3064
2Y	-0,5620	-1	-10	-0,6045	-0,4721	-0,2393
3Y	-0,5710	-1	-12	-0,5778	-0,4168	-0,1667
4Y	-0,5560	-1	-13	-0,5376	-0,3549	-0,0993
5Y	-0,5270	0	-15	-0,4911	-0,2884	-0,0380
7Y	-0,4370	1	-18	-0,3773	-0,1618	0,0556
10Y	-0,2670	1	-21	-0,2059	-0,0185	0,1593
15Y	-0,0470	2	-26	-0,0125	0,1155	0,2290
20Y	0,0650	2	-30	0,0776	0,1609	0,2308
30Y	0,1130	2	-32	0,0994	0,1401	0,1715

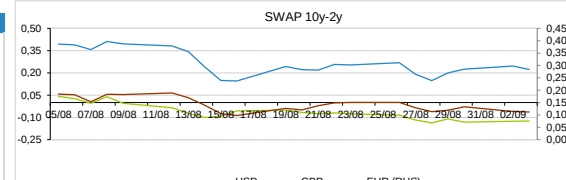
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,00
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7850	2	-30	1,1622	1,0790	1,2565
2Y	1,5110	1	-37	1,1200	1,1376	1,2810
3Y	1,4000	2	-42	1,1165	1,1750	1,3150
4Y	1,3330	-2	-48	1,1150	1,2010	1,3490
5Y	1,3110	-2	-51	1,1410	1,2504	1,4009
7Y	1,3190	-3	-57	1,2114	1,3080	1,4380
10Y	1,3740	-4	-63	1,3060	1,3870	1,4880
15Y	1,4610	-4	-67	1,3720	1,4435	1,5150
20Y	1,5140	-5	-69	1,4260	1,4755	1,5220
30Y	1,5810	4	-64	1,4515	1,4790	1,5391

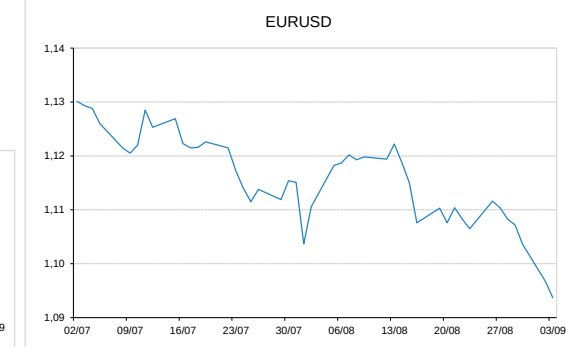
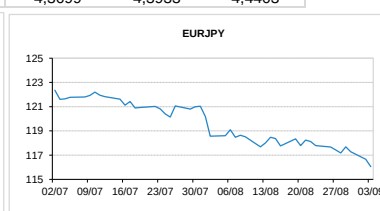


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	57,73	-0,93	-3,59	OT 2Y	-0,670	-0,02	-11,30
JETFUEL	595,65	-16,60	-20,60	OT 5Y	-0,347	0,00	-10,20
DIESEL	565,20	-12,80	-18,05	OT 10Y	0,124	-0,01	-16,80
COBRE	5.617,00	-32,00	-109,50	BUND 10Y	-1,348	-1,83	-22,60
ZINCO	2.250,50	41,50	-105,50	SCHATZ 2Y	-0,256	1,14	-10,50
OURO	1.547,51	18,24	100,52	T-NOTE 10Y	2,358	-5,38	-28,10
TRIGO	452,75	-9,75	-38,75	T-NOTE 2Y	1,815	-6,08	-22,30
LICENÇA C02	25,23	0,04	-4,03	GILT 10Y	0,410	-2,41	-22,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0937	-0,28%	-2,19%	1,1013	1,1088	1,1218
EUR/GBP	0,90885	-0,07%	1,09%	0,9118	0,9149	0,9212
EUR/JPY	116,05	0,53%	2,21%	116,05	116,05	116,05
EUR/CHF	1,0826	0,33%	0,66%	1,0813	1,0797	1,0771
EUR/BRL	4,5689	0,55%	-2,51%	4,6297	4,6907	4,8219
EUR/PLN	4,3467	0,31%	-0,68%	4,3699	4,3933	4,4403



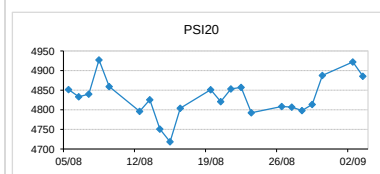
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0937	0,9089	116,05	1,0826	10,7902	7,4570	1,4618	1,62256	4,5689	9,9852
USD	0,9121	-	0,8268	105,885	0,9875	9,8507	6,8015	1,3339	1,4803	4,1601	9,1161

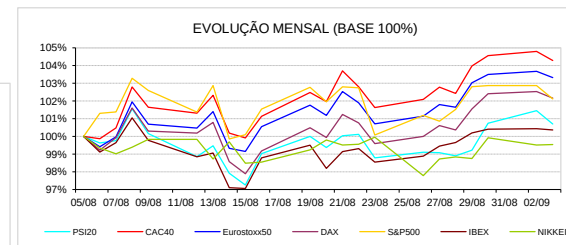
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,705	-0,35	-1,64
BCP	0,192	-0,10	-16,34
CORT. AMORIM	9,170	0,22	1,89
CTT	1,886	-0,21	-35,98
EDP	3,460	-0,17	13,48
EDP R	9,890	-0,80	27,20
GALP	12,765	-1,85	-7,47
IBERSOL	8,140	-0,73	3,04
J MARTINS	15,650	0,06	51,35
MOTA ENGIL	1,878	-1,31	16,65
NAVIGATOR	3,030	-1,05	-15,83
NOS	5,265	-1,86	-0,57
NOVABASE	2,870	0,00	42,08
PHAROL	0,113	-2,93	-31,00
RAMADA	6,380	0,63	-14,93
REN	11,900	-1,33	-9,16
SEMAPA	0,619	-0,16	-27,09
SONAE CAP.	0,829	-0,72	2,35
SONAE SGPS	6,380	0,63	-14,93

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
RAMADA	0,63
RAMADA	0,63
CORT. AMORIM	0,22
J MARTINS	0,06
MOTA ENGIL	-1,31
REN	-1,33
GALP	-1,85
NOS	-1,86
PHAROL	-2,93



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.885,41	-0,74%	3,25%	5.432,36	4.551,84
CAC40	5.466,07	-0,49%	15,54%	5.672,77	4.555,99
ESTX 50 PR	3.420,74	-0,34%	13,97%	3.573,57	2.908,70
XTRA DAX	11.910,86	-0,36%	12,80%	12.656,05	10.279,20
S&P 500	2.905,41	-0,73%	15,89%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	8.809,20	-0,07%	3,15%	9.665,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.625,16	0,02%	3,05%	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.