

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

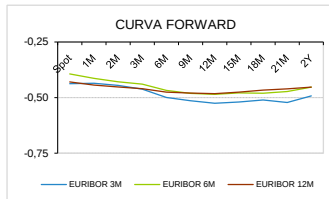
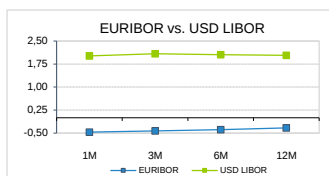
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

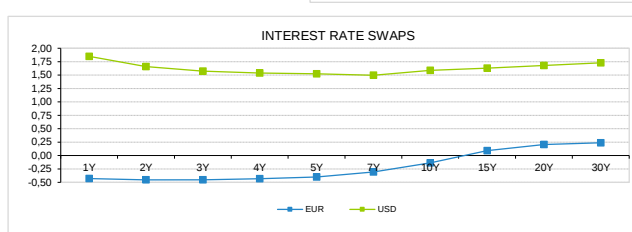
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4670	-1	-4	1M	2,0156	-2	-7	0,7153	-0,8100
3M	-0,4280	-1	1	3M	2,0851	-1	-5	0,7580	-0,7632
6M	-0,3870	0	4	6M	2,0556	-1	2	0,8268	-0,7174
12M	-0,3300	0	5	12M	2,0321	-1	6	0,8895	-0,6128

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4295	0	8	-0,4836	-0,3920	-0,1763
2Y	-0,4540	-1	10	-0,4676	-0,3452	-0,1017
3Y	-0,4530	-1	11	-0,4444	-0,2883	-0,0269
4Y	-0,4310	0	12	-0,4073	-0,2228	0,0438
5Y	-0,4000	0	13	-0,3607	-0,1533	0,1110
7Y	-0,3080	1	14	-0,2433	-0,0211	0,2164
10Y	-0,1370	2	14	-0,0618	0,1371	0,3309
15Y	0,0920	4	16	0,1449	0,2787	0,4062
20Y	0,2050	5	16	0,2420	0,3277	0,4008
30Y	0,2380	6	15	0,2547	0,2939	0,3227

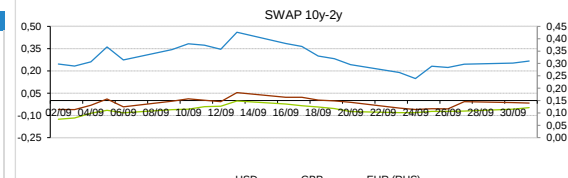
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,8490	0	6	1,5020	1,3240	1,4680
2Y	1,6570	2	14	1,3175	1,3645	1,4935
3Y	1,5740	3	17	1,3270	1,3925	1,5270
4Y	1,5370	3	18	1,3586	1,4255	1,5610
5Y	1,5240	4	19	1,3824	1,4585	1,6145
7Y	1,4960	-10	8	1,4180	1,5245	1,6420
10Y	1,5870	4	18	1,5090	1,5960	1,6885
15Y	1,6300	-9	6	1,5970	1,6665	1,7315
20Y	1,6780	-9	5	1,6500	1,6940	1,7375
30Y	1,7280	3	14	1,6700	1,6955	1,7210

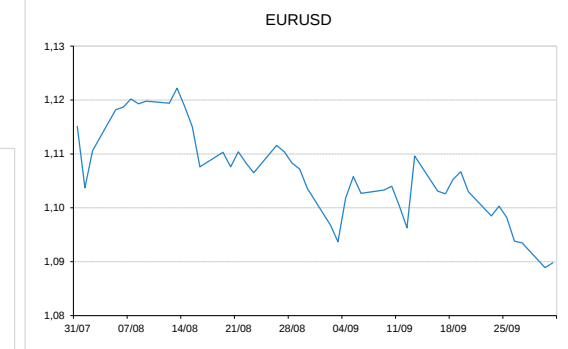
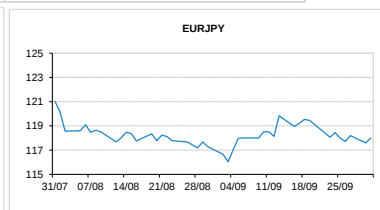
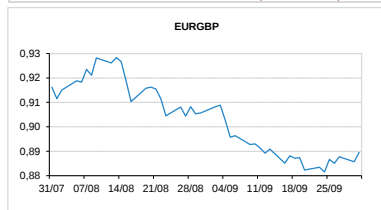


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	59,12	-0,13	0,66	OT 2Y	-0,627	-0,03	1,10
JETFUEL	612,25	-38,25	0,00	OT 5Y	-0,258	0,02	8,30
DIESEL	578,00	-30,42	0,00	OT 10Y	0,176	0,02	5,10
COBRE	5.711,50	-42,00	73,00	BUND 10Y	-1,010	0,61	14,30
ZINCO	2.431,50	82,00	221,50	SCHATZ 2Y	-0,146	0,46	16,70
OURO	1.482,97	12,43	-40,13	T-NOTE 10Y	2,493	-5,45	8,20
TRIGO	492,00	-3,75	29,50	T-NOTE 2Y	1,960	-6,68	8,40
LICENÇA C02	25,11	0,39	-1,21	GILT 10Y	0,469	-1,91	-1,50



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0898	0,08%	-0,64%	1,0977	1,1043	1,1170
EUR/GBP	0,88955	-0,43%	2,10%	0,8925	0,8955	0,9016
EUR/JPY	118	-0,35%	-1,14%	118,00	118,00	118,00
EUR/CHF	1,0864	0,15%	-0,01%	1,0852	1,0843	1,0826
EUR/BRL	4,5528	-0,48%	0,91%	4,6032	4,6517	4,7781
EUR/PLN	4,3845	-0,31%	-0,55%	4,4101	4,4330	4,4826



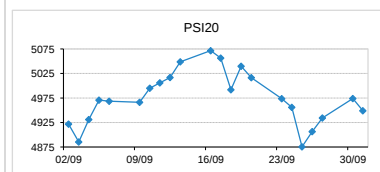
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0898	0,8896	118,00	1,0864	10,7983	7,4654	1,4466	1,63141	4,5528	9,9690
USD	0,9161	-	0,818	107,865	0,9966	9,8971	6,8394	1,3253	1,4945	4,1749	9,1315

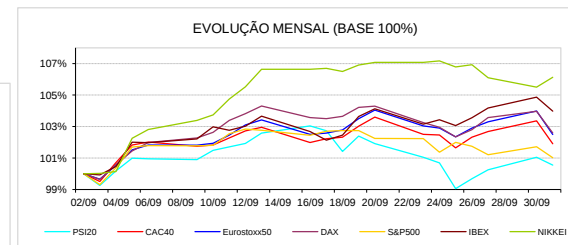
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,010	-1,39	3,62
BCP	0,187	-1,68	-18,34
CORT. AMORIM	9,800	-1,71	8,89
CTT	2,086	-1,79	-29,19
EDP	3,576	0,39	17,28
EDP R	9,830	-0,61	26,43
GALP	13,730	-0,69	-0,47
IBERSOL	8,060	-0,25	2,03
J MARTINS	15,290	-1,23	47,87
MOTA ENGIL	1,782	-1,60	10,68
NAVIGATOR	3,184	-2,99	-11,56
NOS	5,095	1,70	-3,78
NOVABASE	2,790	-2,45	38,12
PHAROL	0,109	-1,97	-32,97
RAMADA	6,180	3,34	-17,60
REN	11,600	-0,85	-11,45
SEMAPA	0,616	0,98	-27,44
SONAE CAP.	0,865	1,11	6,73
SONAE SGPS	6,180	3,34	-17,60

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
RAMADA	3,34
RAMADA	3,34
NOS	1,70
SONAE CAP.	1,11
SEMAPA	0,98
CORT. AMORIM	-1,71
CTT	-1,79
PHAROL	-1,97
NOVABASE	-2,45
NAVIGATOR	-2,99



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.948,99	-0,50%	4,60%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.597,63	-1,41%	18,33%	5.704,93	4.555,99
ESTX 50 PR	3.518,25	-1,43%	17,22%	3.588,68	2.908,70
XTRA DAX	12.263,83	-1,32%	16,15%	12.656,05	10.279,20
S&P 500	2.956,16	-0,69%	17,93%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	9.165,90	-0,85%	7,33%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	21.885,24	0,59%	9,35%	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.