

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

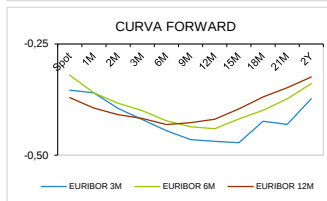
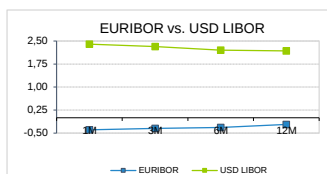
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

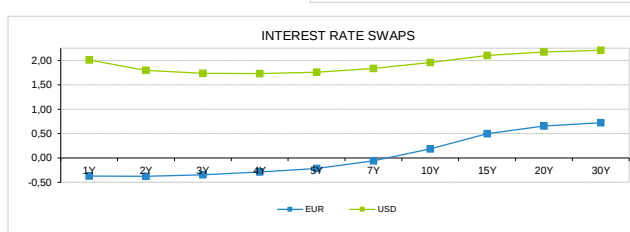
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3920	0	-1	1M	2,3980	0	-3	0,7218	-0,8114
3M	-0,3460	0	-2	3M	2,3199	0	-20	0,7738	-0,7256
6M	-0,3130	0	-6	6M	2,2005	-1	-34	0,8511	-0,6930
12M	-0,2170	0	-5	12M	2,1781	-1	-42	0,9545	-0,5854

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3712	-1	-9	-0,4207	-0,1700	0,2068
2Y	-0,3760	-1	-12	-0,3740	-0,0779	0,3038
3Y	-0,3450	-1	-13	-0,3060	0,0150	0,4001
4Y	-0,2880	-2	-14	-0,2245	0,1120	0,4910
5Y	-0,2170	-2	-15	-0,1383	0,2077	0,5675
7Y	-0,0580	-2	-16	0,0427	0,3838	0,7040
10Y	0,1870	-2	-18	0,2914	0,5842	0,8460
15Y	0,4960	-2	-21	0,5677	0,7726	0,9500
20Y	0,6560	-2	-23	0,7062	0,8455	0,9539
30Y	0,7230	-2	-24	0,7486	0,8265	0,8844

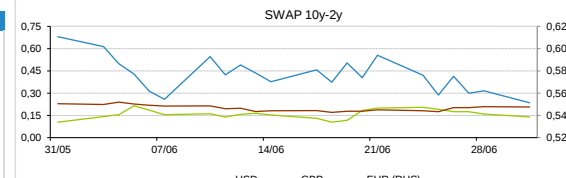
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,25
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,0090	1	-38	1,6292	1,7270	1,8613
2Y	1,7970	1	-38	1,6170	1,7865	2,0527
3Y	1,7360	1	-36	1,6692	1,8345	2,0277
4Y	1,7300	1	-37	1,7000	1,9070	2,1476
5Y	1,7580	0	-32	1,7530	1,9709	2,1906
7Y	1,8350	-1	-30	1,8680	2,0520	2,2370
10Y	1,9580	-1	-28	1,9925	2,1595	2,2850
15Y	2,1030	-1	-25	2,1425	2,2350	2,3245
20Y	2,1720	-1	-24	2,1775	2,2888	2,3240
30Y	2,2080	-1	-23	2,2020	2,2545	2,3192

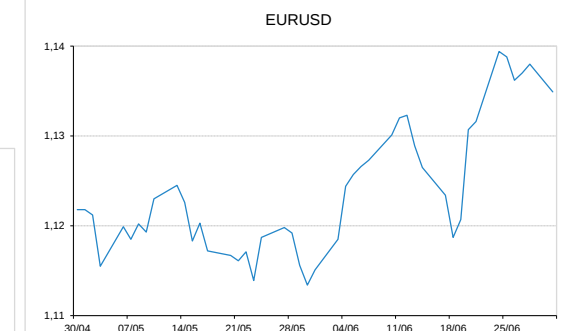
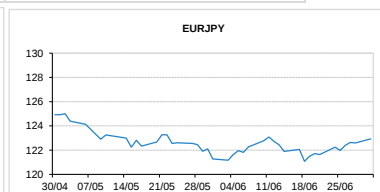
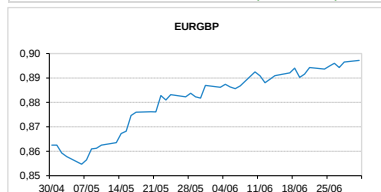


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,84	0,10	3,68	OT 2Y	-0,450	-0,03	-45,00
JETFUEL	639,50	2,75	-14,16	OT 5Y	-0,219	-0,05	-21,90
DIESEL	600,50	2,00	-22,91	OT 10Y	0,411	-0,07	-41,20
COBRE	6.001,00	4,00	33,00	BUND 10Y	-0,950	-3,69	-95,30
ZINCO	2.545,00	17,00	-70,00	SCHATZ 2Y	-0,137	-0,69	-13,70
OURO	1.388,62	-20,98	83,97	T-NOTE 10Y	2,790	1,24	279,00
TRIGO	512,50	-14,75	2,75	T-NOTE 2Y	2,139	3,44	213,90
LICENÇA C02	26,88	0,60	2,42	GILT 10Y	0,800	-3,50	-80,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1349	-0,27%	1,47%	1,1431	1,1513	1,1655
EUR/GBP	0,89718	-0,07%	-1,23%	0,9000	0,9032	0,9096
EUR/JPY	122,93	-0,27%	-1,43%	122,93	122,93	122,93
EUR/CHF	1,1155	-0,46%	0,24%	1,1144	1,1132	1,1109
EUR/BRL	4,3218	1,30%	1,10%	4,3919	4,4580	4,5862
EUR/PLN	4,2401	0,10%	0,95%	4,2620	4,2873	4,3357



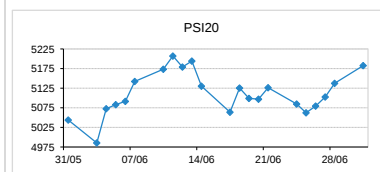
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1349	0,8972	122,93	1,1155	10,5566	7,4635	1,4843	1,62417	4,3218	9,6948
USD	0,8830	-	0,7904	108,31	0,9846	9,3252	6,5906	1,3103	1,4352	3,8155	8,5537

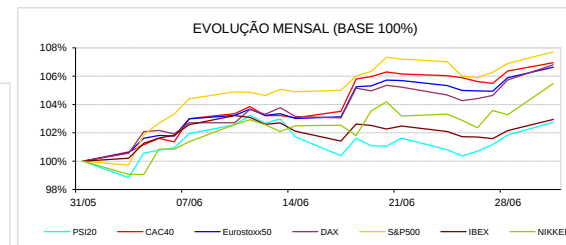
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,220	1,88	7,24
BCP	0,275	1,14	19,83
CORT. AMORIM	10,140	-0,39	12,67
CTT	2,144	1,32	-27,22
EDP	3,350	-0,03	9,58
EDP R	8,950	-0,78	15,11
GALP	13,750	1,66	-0,33
IBERSOL	8,040	0,00	1,77
J MARTINS	14,525	2,54	40,47
MOTA ENGIL	1,937	1,73	20,37
NAVIGATOR	3,412	1,61	-5,22
NOS	5,725	-0,95	8,12
NOVABASE	2,320	-0,42	18,32
PHAROL	0,152	0,40	-7,11
RAMADA	7,180	1,99	-4,27
REN	12,560	1,78	-3,97
SEMAPA	0,740	1,51	-12,84
SONAE CAP.	0,864	1,65	6,60
SONAE SGPS	7,180	1,99	-4,27

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
J MARTINS	2,54
RAMADA	1,99
RAMADA	1,99
ALTRI	1,88
REN	1,78
EDP	-0,03
CORT. AMORIM	-0,39
NOVABASE	-0,42
EDP R	-0,78
NOS	-0,95



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.182,44	0,88%	9,53%	5.686,45	4.551,84
CAC40	5.569,60	0,55%	17,73%	5.611,28	4.555,99
ESTX 50 PR	3.498,03	0,70%	16,55%	3.536,87	2.908,70
XTRA DAX	12.524,15	1,01%	18,62%	12.886,83	10.279,20
S&P 500	2.964,38	0,77%	18,25%	2.977,93	2.346,58
IBEX 35	9.269,80	0,77%	8,55%	9.971,60	8.286,20
NIKKEI 225	21.729,97	2,13%	8,57%	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.