

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

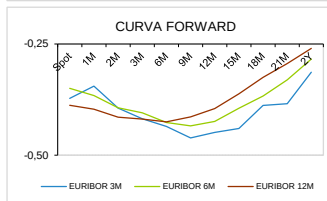
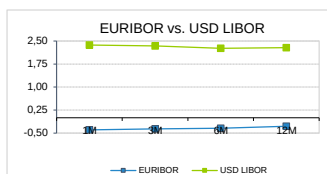
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

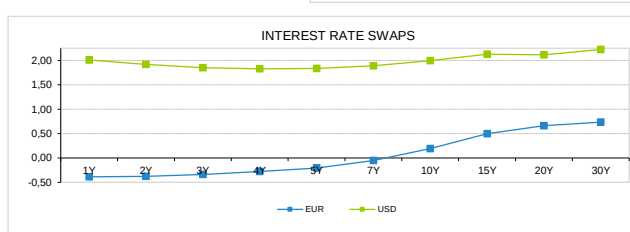
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3940	-1	-2	1M	2,3691	0	-4	0,7220	-0,8106
3M	-0,3640	-1	-5	3M	2,3395	0	-10	0,7758	-0,7486
6M	-0,3420	-1	-8	6M	2,2624	1	-9	0,8230	-0,7016
12M	-0,2770	-2	-10	12M	2,2858	1	-5	0,9053	-0,5848

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3871	0	-10	-0,3952	-0,0774	0,2969
2Y	-0,3780	2	-8	-0,3275	0,0184	0,3924
3Y	-0,3400	3	-7	-0,2437	0,1110	0,4803
4Y	-0,2790	4	-6	-0,1544	0,2048	0,5700
5Y	-0,2070	5	-6	-0,0643	0,2944	0,6520
7Y	-0,0510	6	-7	0,1160	0,4666	0,7778
10Y	0,1930	7	-8	0,3629	0,6617	0,9238
15Y	0,4990	8	-10	0,6397	0,8487	1,0220
20Y	0,6620	8	-10	0,7759	0,9178	1,0250
30Y	0,7350	8	-11	0,8159	0,8956	0,9501

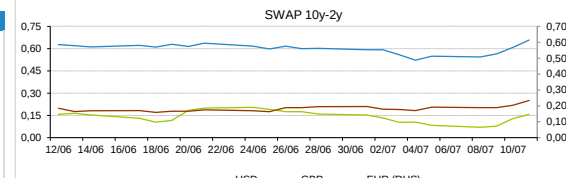
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,0090	1	-38	1,7147	1,8173	2,0694
2Y	1,9200	13	4	1,7236	1,8670	2,0960
3Y	1,8500	13	3	1,7400	1,9403	2,1480
4Y	1,8280	13	1	1,7986	1,9947	2,2130
5Y	1,8340	2	-1	1,8330	2,0330	2,2579
7Y	1,8910	11	-3	1,9340	2,1240	2,3212
10Y	1,9970	2	-5	2,0842	2,2230	2,3530
15Y	2,1280	9	-6	2,2086	2,3200	2,3895
20Y	2,1140	-7	-16	2,2500	2,3290	2,3900
30Y	2,2240	3	-7	2,2750	2,3356	2,3590

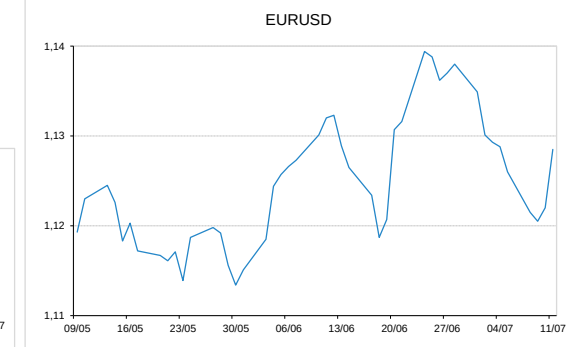
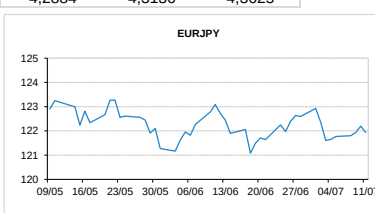


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	67,10	0,09	5,65	OT 2Y	-0,438	0,00	-11,70
JETFUEL	652,75	8,73	56,36	OT 5Y	-0,097	0,05	-2,30
DIESEL	614,00	8,73	50,86	OT 10Y	0,568	0,07	-7,90
COBRE	5.965,00	118,00	66,00	BUND 10Y	-0,857	4,28	-3,60
ZINCO	2.402,00	45,50	-120,00	SCHATZ 2Y	-0,108	0,46	-5,80
OURO	1.412,37	0,28	83,90	T-NOTE 10Y	2,855	2,50	-4,00
TRIGO	500,75	-4,00	-20,50	T-NOTE 2Y	2,227	2,88	-0,20
LICENÇA C02	28,27	0,08	3,29	GILT 10Y	0,829	8,49	-1,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1285	0,58%	-0,31%	1,1367	1,1449	1,1593
EUR/GBP	0,8979	0,15%	-0,79%	0,9007	0,9039	0,9100
EUR/JPY	121,94	0,21%	0,94%	121,94	121,94	121,94
EUR/CHF	1,1135	0,07%	0,91%	1,1123	1,1111	1,1090
EUR/BRL	4,2266	0,00%	3,43%	4,2918	4,3532	4,4748
EUR/PLN	4,2668	0,03%	-0,09%	4,2884	4,3136	4,3625



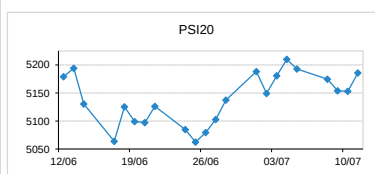
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1285	0,8979	121,94	1,1135	10,5691	7,4674	1,4719	1,61283	4,2266	9,6236
USD	0,8886	-	0,7976	108,325	0,9891	9,3904	6,6355	1,3088	1,4332	3,7579	8,5513

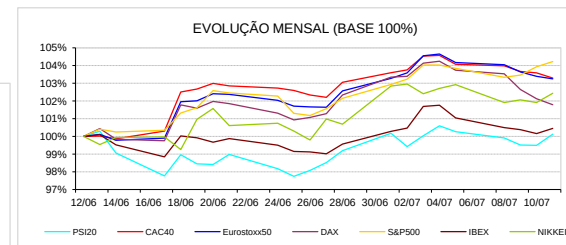
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,890	-1,17	1,55
BCP	0,283	0,07	23,49
CORT. AMORIM	9,870	-0,90	9,67
CTT	2,000	-1,09	-32,11
EDP	3,370	0,60	10,53
EDP R	9,050	0,00	16,40
GALP	13,870	2,74	0,54
IBERSOL	8,120	0,00	2,78
J MARTINS	14,435	1,23	39,60
MOTA ENGIL	1,896	0,42	17,76
NAVIGATOR	3,200	-0,37	-11,11
NOS	5,755	1,95	8,69
NOVABASE	2,340	0,86	15,84
PHAROL	0,150	-0,79	-7,84
RAMADA	6,980	-1,13	-6,93
REN	12,240	-2,55	-6,56
SEMAPA	0,740	0,82	-12,84
SONAE CAP.	0,853	-0,41	5,31
SONAE SGPS	6,980	-1,13	-6,93

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
GALP	2,74
NOS	1,95
J MARTINS	1,23
NOVABASE	0,86
SEMAPA	0,82
CTT	-1,09
RAMADA	-1,13
RAMADA	-1,13
ALTRI	-1,17
REN	-2,55



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.185,69	0,63%	9,60%	5.661,87	4.551,84
CAC40	5.551,95	-0,28%	17,36%	5.629,79	4.555,99
ESTX 50 PR	3.496,73	-0,14%	16,50%	3.549,26	2.908,70
XTRA DAX	12.332,12	-0,33%	16,79%	12.886,83	10.279,20
S&P 500	3.001,57	0,28%	19,73%	3.002,98	2.346,58
IBEX 35	9.280,30	0,30%	8,67%	9.924,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.643,53	0,51%	8,14%	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.