

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

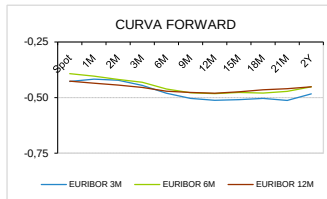
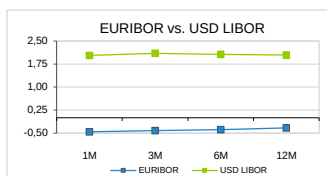
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

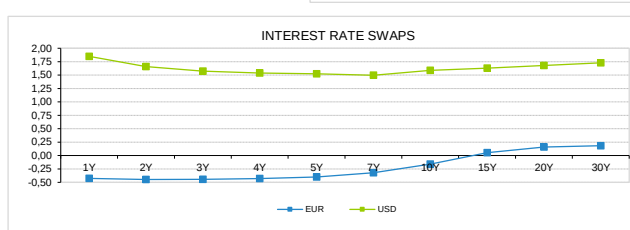
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4570	1	-3	1M	2,0315	-1	-8	0,7135	-0,8048
3M	-0,4180	-1	2	3M	2,0986	-1	-2	0,7609	-0,7672
6M	-0,3860	-1	4	6M	2,0630	0	3	0,8285	-0,7144
12M	-0,3300	-1	5	12M	2,0433	2	9	0,8921	-0,5982

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4255	0	9	-0,4820	-0,3820	-0,1647
2Y	-0,4470	0	8	-0,4688	-0,3354	-0,0988
3Y	-0,4450	1	9	-0,4392	-0,2781	-0,0263
4Y	-0,4280	1	8	-0,4018	-0,2165	0,0400
5Y	-0,4000	2	8	-0,3541	-0,1495	0,1040
7Y	-0,3200	2	7	-0,2399	-0,0209	0,2083
10Y	-0,1610	2	6	-0,0637	0,1317	0,3195
15Y	0,0530	2	5	0,1375	0,2683	0,3898
20Y	0,1570	2	3	0,2301	0,3141	0,3832
30Y	0,1830	1	0	0,2412	0,2804	0,3087

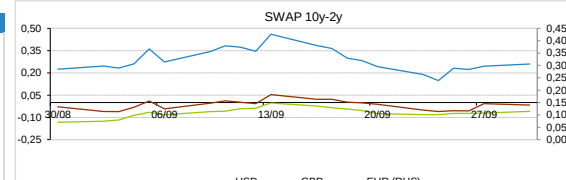
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,50
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,8490	0	6	1,4685	1,4140	1,5253
2Y	1,6570	2	14	1,4030	1,4390	1,5320
3Y	1,5740	3	17	1,4005	1,4505	1,5650
4Y	1,5370	3	18	1,4292	1,4700	1,6000
5Y	1,5240	4	19	1,4320	1,5095	1,6523
7Y	1,4960	-10	8	1,4770	1,5740	1,6715
10Y	1,5870	4	18	1,5590	1,6295	1,7265
15Y	1,6300	-9	6	1,6355	1,6865	1,7665
20Y	1,6780	-9	5	1,6900	1,7255	1,7550
30Y	1,7280	3	14	1,6925	1,7224	1,7585

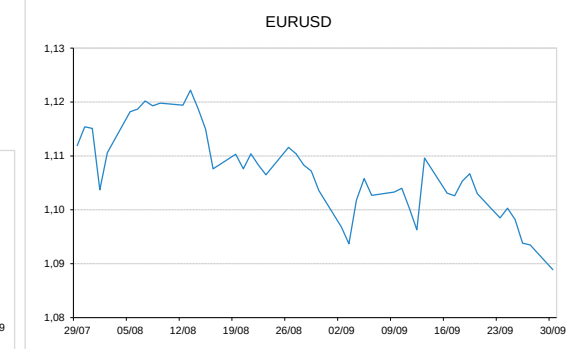
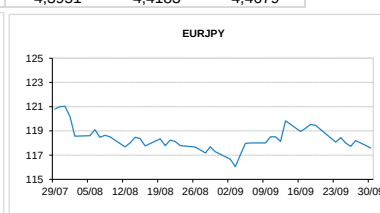


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	60,82	-1,09	1,57	OT 2Y	-0,594	0,00	3,40
JETFUEL	650,50	10,83	54,25	OT 5Y	-0,280	0,02	5,20
DIESEL	608,42	10,50	49,92	OT 10Y	0,158	-0,01	3,20
COBRE	5.762,00	45,00	84,00	BUND 10Y	-1,011	0,27	13,00
ZINCO	2.349,50	13,00	69,75	SCHATZ 2Y	-0,146	0,23	14,90
OURO	1.469,53	-32,69	-53,57	T-NOTE 10Y	2,555	1,52	13,50
TRIGO	485,50	-1,75	23,00	T-NOTE 2Y	2,036	1,72	13,70
LICENÇA C02	24,99	-0,31	-1,33	GILT 10Y	0,479	-2,26	4,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0889	-0,42%	-0,72%	1,0969	1,1036	1,1164
EUR/GBP	0,88573	0,23%	2,54%	0,8888	0,8917	0,8976
EUR/JPY	117,59	0,53%	-0,79%	117,59	117,59	117,59
EUR/CHF	1,0878	-0,34%	-0,14%	1,0865	1,0856	1,0840
EUR/BRL	4,5378	0,26%	1,23%	4,5951	4,6480	4,7621
EUR/PLN	4,3693	0,30%	-0,21%	4,3951	4,4183	4,4679



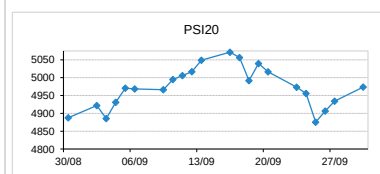
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0889	0,8857	117,59	1,0878	10,7165	7,4669	1,4437	1,61606	4,5378	9,9032
USD	0,9172	-	0,8113	108,065	0,9974	9,8289	6,8481	1,3239	1,4826	4,1655	9,0828

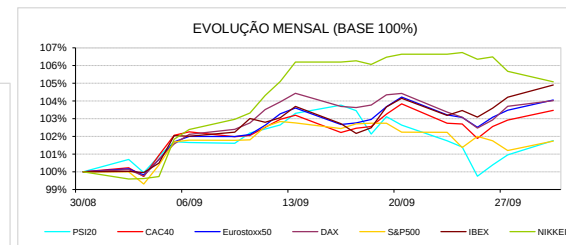
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,075	0,33	4,74
BCP	0,191	1,59	-16,60
CORT. AMORIM	9,950	0,30	10,56
CTT	2,120	3,11	-28,04
EDP	3,560	-0,28	16,73
EDP R	9,920	0,40	27,33
GALP	13,825	1,10	0,18
IBERSOL	8,060	-0,25	2,03
J MARTINS	15,445	0,06	49,47
MOTA ENGIL	1,810	0,56	12,42
NAVIGATOR	3,278	1,87	-9,00
NOS	5,015	1,93	-5,29
NOVABASE	2,860	-1,38	41,58
PHAROL	0,111	2,02	-31,86
RAMADA	5,980	1,36	-20,27
REN	11,680	0,86	-10,84
SEMAPA	0,599	-0,17	-29,45
SONAE CAP.	0,855	0,12	5,68
SONAE SGPS	5,980	1,36	-20,27

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	3,11
PHAROL	2,02
NOS	1,93
NAVIGATOR	1,87
BCP	1,59
SEMAPA	-0,17
IBERSOL	-0,25
EDP R	-0,40
NOVABASE	-1,38



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.972,75	0,80%	5,12%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.669,40	0,53%	19,87%	5.696,25	4.555,99
ESTX 50 PR	3.564,77	0,56%	18,80%	3.578,04	2.908,70
XTRA DAX	12.418,44	0,32%	17,63%	12.656,05	10.279,20
S&P 500	2.977,24	0,52%	18,77%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	9.241,50	0,66%	8,26%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	21.755,84	-0,56%	8,70%	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.