

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

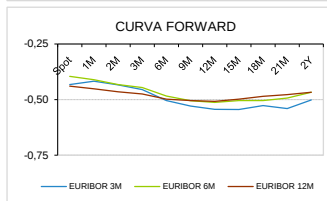
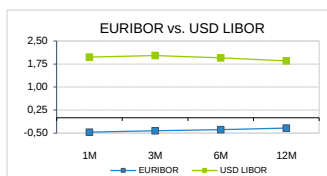
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

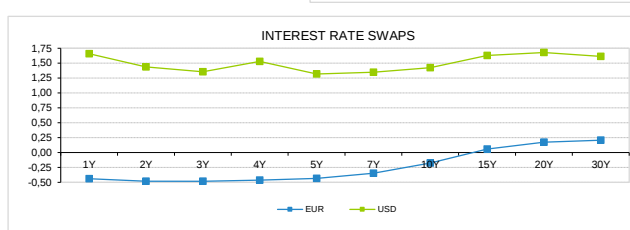
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4680	1	-2	1M	1,9780	-1	-8	0,7140	-0,8068
3M	-0,4230	0	1	3M	2,0270	-2	-9	0,7598	-0,7830
6M	-0,3890	0	3	6M	1,9506	-3	-4	0,8211	-0,7322
12M	-0,3360	0	2	12M	1,8531	-6	-4	0,8938	-0,6326

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4390	0	4	-0,5100	-0,3868	-0,1740
2Y	-0,4800	-1	8	-0,4902	-0,3394	-0,1020
3Y	-0,4820	-1	8	-0,4560	-0,2817	-0,0300
4Y	-0,4630	-1	8	-0,4139	-0,2184	0,0400
5Y	-0,4350	-1	8	-0,3650	-0,1511	0,1065
7Y	-0,3480	-2	8	-0,2468	-0,0200	0,2120
10Y	-0,1770	-2	8	-0,0663	0,1353	0,3260
15Y	0,0570	-1	8	0,1409	0,2775	0,4013
20Y	0,1730	-1	9	0,2365	0,3230	0,3943
30Y	0,2070	-1	8	0,2475	0,2880	0,3173

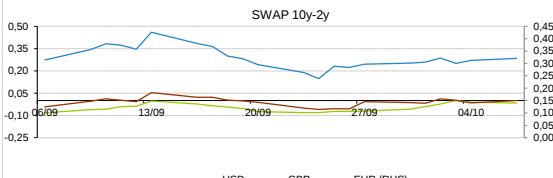
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,6580	-18	-7	1,2641	1,2525	1,4000
2Y	1,4360	0	-1	1,2390	1,2870	1,4370
3Y	1,3550	-21	3	1,2440	1,3376	1,4740
4Y	1,5290	-1	20	1,2620	1,3560	1,5100
5Y	1,3180	-20	5	1,2890	1,3930	1,5685
7Y	1,3470	-15	6	1,3510	1,4710	1,5980
10Y	1,4240	-16	7	1,4460	1,5490	1,6480
15Y	1,6300	-9	6	1,5460	1,6230	1,6950
20Y	1,6780	-9	5	1,6108	1,6642	1,6990
30Y	1,6140	-13	7	1,6240	1,6645	1,6805

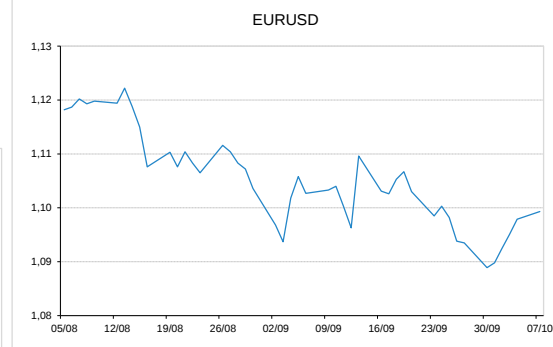
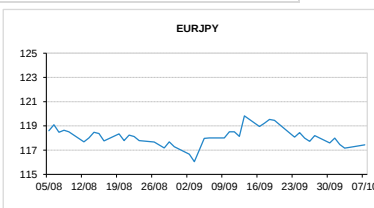
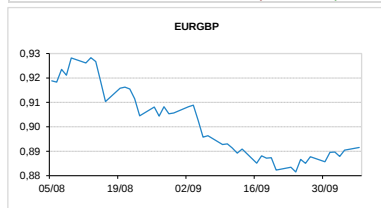


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	59,09	0,72	-1,48	OT 2Y	-0,619	0,00	2,40
JETFUEL	617,90	11,63	4,37	OT 5Y	-0,265	-0,01	-1,10
DIESEL	581,40	12,63	-0,63	OT 10Y	0,136	-0,01	-11,20
COBRE	5.673,00	-19,00	-105,00	BUND 10Y	-1,020	1,22	1,30
ZINCO	2.338,50	1,00	20,50	SCHATZ 2Y	-0,151	0,68	9,80
OURO	1.498,68	-9,80	-19,08	T-NOTE 10Y	2,417	2,40	-3,50
TRIGO	491,25	0,75	27,50	T-NOTE 2Y	1,876	4,56	-4,50
LICENÇA C02	23,40	0,46	-1,68	GILT 10Y	0,443	1,29	-16,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0993	0,13%	-0,36%	1,1068	1,1131	1,1251
EUR/GBP	0,89155	-0,12%	0,13%	0,8945	0,8974	0,9032
EUR/JPY	117,44	-0,18%	0,49%	117,44	117,44	117,44
EUR/CHF	1,0926	0,01%	0,26%	1,0914	1,0904	1,0886
EUR/BRL	4,4848	-0,68%	0,92%	4,5346	4,5803	4,6979
EUR/PLN	4,3281	-0,17%	0,21%	4,3526	4,3760	4,4264



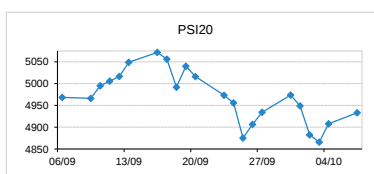
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0993	0,8916	117,44	1,0926	10,8762	7,4688	1,4619	1,6301	4,4848	10,0285
USD	0,9095	-	0,8114	106,92	0,9933	9,8902	6,7926	1,3306	1,4816	4,0660	9,1200

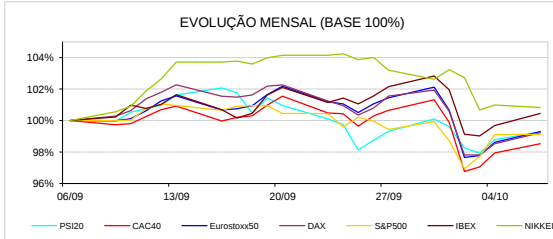
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,390	-3,58	-7,07
BCP	0,190	0,05	-17,12
CORT. AMORIM	9,360	-1,37	4,00
CTT	2,134	1,14	-27,56
EDP	3,657	0,88	19,94
EDP R	9,800	-0,20	26,05
GALP	13,670	2,24	-0,91
IBERSOL	8,040	0,00	1,77
J MARTINS	15,065	1,01	45,70
MOTA ENGIL	1,744	-1,80	8,32
NAVIGATOR	3,044	0,20	-15,44
NOS	5,160	1,18	-2,55
NOVABASE	2,760	-0,72	36,63
PHAROL	0,107	0,00	-34,44
RAMADA	5,960	-0,67	-20,53
REN	11,300	0,53	-13,74
SEMAPA	0,610	-0,33	-28,15
SONAE CAP.	0,850	1,07	4,94
SONAE SGPS	5,960	-0,67	-20,53

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
GALP	2,24
NOS	1,18
CTT	1,14
SONAE CAP.	1,07
J MARTINS	1,01
RAMADA	-0,67
NOVABASE	-0,72
CORT. AMORIM	-1,37
MOTA ENGIL	-1,80
ALTRI	-3,58



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.933,21	0,52%	4,26%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.521,61	0,61%	16,72%	5.704,93	4.555,99
ESTX 50 PR	3.470,68	0,70%	15,63%	3.588,68	2.908,70
XTRA DAX	12.097,43	0,70%	14,57%	12.656,05	10.279,20
S&P 500	2.952,73	0,02%	17,78%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	9.030,50	0,77%	5,74%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	21.375,25	-0,16%	6,80%	23.928,62	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.