

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

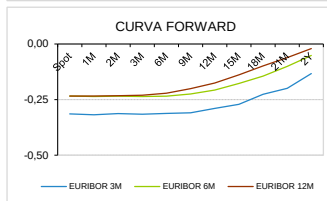
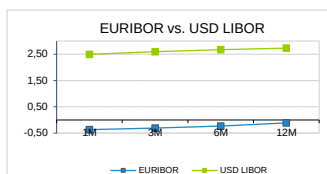
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

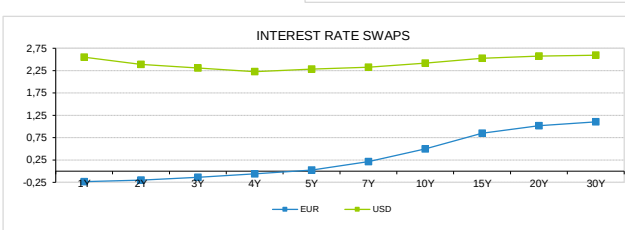
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4934	0	1	0,7294	-0,7898
3M	-0,3110	0	0	3M	2,5955	0	0	0,8409	-0,7132
6M	-0,2300	0	0	6M	2,6691	1	-1	0,9534	-0,6548
12M	-0,1120	0	0	12M	2,7300	2	-15	1,0560	-0,4978

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2341	0	-2	-0,1774	0,1551	0,5513
2Y	-0,2000	1	-7	-0,0982	0,2493	0,6625
3Y	-0,1360	1	-10	-0,0135	0,3494	0,7698
4Y	-0,0610	1	-13	0,0763	0,4552	0,8719
5Y	0,0250	1	-15	0,1707	0,5598	0,9560
7Y	0,2140	2	-18	0,3707	0,7520	1,1124
10Y	0,4990	3	-21	0,6490	0,9727	1,2615
15Y	0,8480	4	-22	0,9420	1,1663	1,3616
20Y	1,0180	5	-22	1,0810	1,2364	1,3630
30Y	1,1030	5	-20	1,1314	1,2258	1,3010

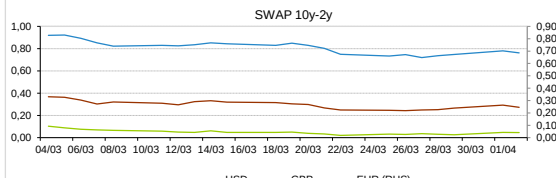
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5500	3	-12	2,2751	2,2538	2,4405
2Y	2,3870	5	-23	2,2110	2,3036	2,4880
3Y	2,3070	5	-27	2,2180	2,3300	2,5260
4Y	2,2260	6	-34	2,2674	2,3790	2,5855
5Y	2,2850	5	-29	2,2820	2,4280	2,6224
7Y	2,3270	5	-30	2,3625	2,5000	2,6787
10Y	2,4160	4	-31	2,4886	2,5845	2,6950
15Y	2,5270	3	-31	2,5635	2,6460	2,7185
20Y	2,5750	3	-30	2,6060	2,6620	2,7110
30Y	2,5940	2	-29	2,6180	2,6555	2,6830

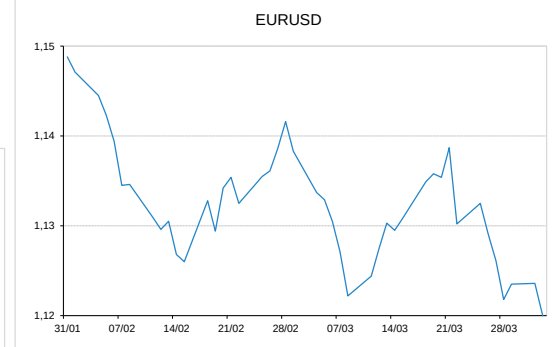
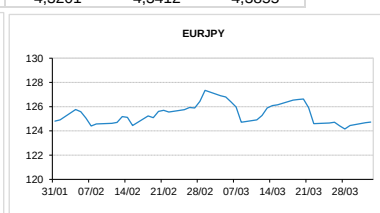


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	69,34	0,33	4,23	OT 2Y	-0,319	-0,01	-7,20
JETFUEL	644,33	2,93	-10,67	OT 5Y	0,162	-0,02	-15,80
DIESEL	611,33	1,33	-19,40	OT 10Y	1,255	-0,02	-23,50
COBRE	6.461,00	-11,50	-7,00	BUND 10Y	-0,447	-2,96	-24,80
ZINCO	2.979,50	4,75	172,00	SCHATZ 2Y	0,005	-0,69	-11,00
OURO	1.290,27	0,62	-8,28	T-NOTE 10Y	3,199	-2,10	-22,70
TRIGO	460,50	-2,25	3,25	T-NOTE 2Y	2,650	-2,13	-24,70
LICENÇA C02	22,04	0,13	-0,24	GILT 10Y	0,927	-3,81	-32,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,12	-0,32%	-1,21%	1,1287	1,1372	1,1542
EUR/GBP	0,86	-0,40%	-0,26%	0,8627	0,8655	0,8712
EUR/JPY	124,73	-0,04%	1,75%	124,73	124,73	124,73
EUR/CHF	1,1171	0,23%	1,42%	1,1160	1,1149	1,1127
EUR/BRL	4,3266	-0,20%	-0,75%	4,3918	4,4615	4,5938
EUR/PLN	4,2989	-0,09%	0,05%	4,3201	4,3412	4,3855



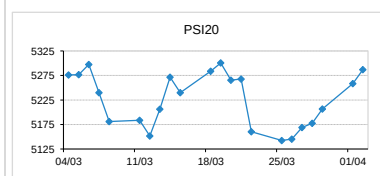
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1200	0,8600	124,73	1,1171	10,4437	7,4651	1,4945	1,58552	4,3266	9,6459
USD	0,8937	-	0,7673	111,315	0,9988	9,3372	6,6716	1,3347	1,4153	3,8743	8,6202

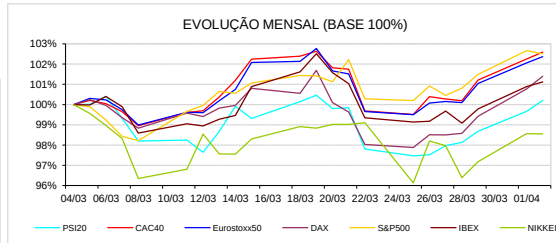
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,055	0,14	21,64
BCP	0,235	0,90	2,35
CORT. AMORIM	10,560	0,76	17,33
CTT	2,646	1,22	-10,18
EDP	3,518	-0,23	15,38
EDP R	8,500	-1,16	9,32
GALP	14,460	-0,03	4,82
IBERSOL	7,820	0,26	-1,01
J MARTINS	13,355	1,25	29,16
MOTA ENGIL	2,174	2,64	35,03
NAVIGATOR	4,164	0,14	15,67
NOS	5,910	2,25	11,61
NOVABASE	2,500	-0,79	23,76
PHAROL	0,187	-1,58	14,34
REN	2,575	0,98	5,79
SEMAPA	14,580	-0,68	11,30
SONAE CAP.	0,872	-0,34	2,71
SONAE SGPS	0,943	-0,05	16,42

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	2,64
NOS	2,25
J MARTINS	1,25
CTT	1,22
REN	0,98
SONAE CAP.	-0,34
SEMAPA	-0,68
NOVABASE	-0,79
EDP R	-1,16
PHAROL	-1,58



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.287,05	0,54%	11,74%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.423,47	0,33%	14,64%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.395,70	0,30%	13,14%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.754,79	0,62%	11,33%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.862,77	-0,15%	14,20%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.363,50	0,23%	9,64%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.505,31	-0,02%	7,45%	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.