

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

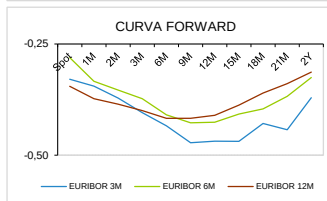
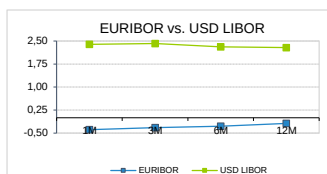
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

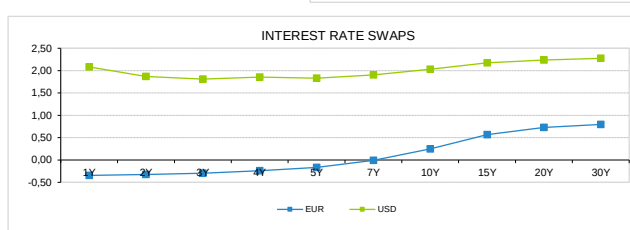
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3880	0	-2	1M	2,3903	1	-5	0,7265	-0,8018
3M	-0,3220	0	-1	3M	2,4185	2	-10	0,7861	-0,7138
6M	-0,2760	-1	-4	6M	2,3088	3	-25	0,8681	-0,6698
12M	-0,1840	-1	-5	12M	2,2868	4	-35	0,9854	-0,5488

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3450	-4	-8	-0,4110	-0,1475	0,2425
2Y	-0,3240	0	-9	-0,3615	-0,0506	0,3405
3Y	-0,2960	0	-11	-0,2902	0,0476	0,4420
4Y	-0,2390	0	-13	-0,2057	0,1456	0,5385
5Y	-0,1670	1	-14	-0,1157	0,2452	0,6225
7Y	-0,0070	1	-16	0,0721	0,4289	0,7605
10Y	0,2490	0	-18	0,3333	0,6345	0,9000
15Y	0,5680	0	-20	0,6114	0,8187	0,9959
20Y	0,7280	0	-21	0,7445	0,8857	0,9960
30Y	0,7960	0	-22	0,7844	0,8656	0,9254

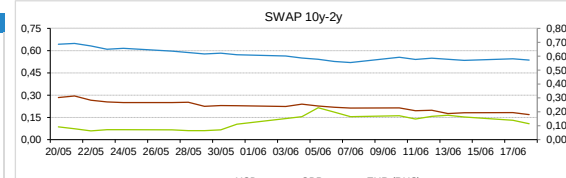
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,25
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,0840	-4	-35	1,6757	1,7290	1,9760
2Y	1,8700	-3	-40	1,6320	1,7870	2,0260
3Y	1,8100	-3	-40	1,6630	1,8470	2,0750
4Y	1,8530	-7	-40	1,7244	1,9070	2,1230
5Y	1,8290	-3	-39	1,7610	1,9590	2,1843
7Y	1,9050	-3	-37	1,8630	2,0470	2,2140
10Y	2,0290	-3	-35	2,0108	2,1475	2,2685
15Y	2,1720	-3	-33	2,1195	2,2310	2,3050
20Y	2,2380	-3	-31	2,1770	2,2400	2,2990
30Y	2,2740	-3	-30	2,1845	2,2280	2,2550

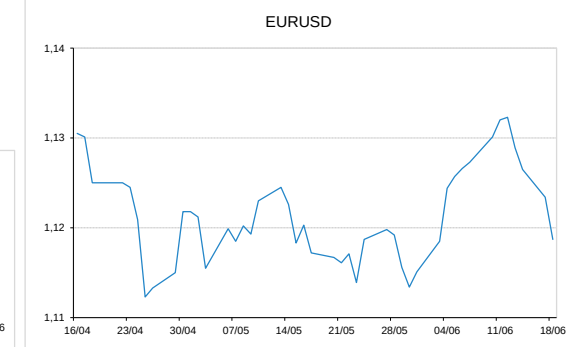
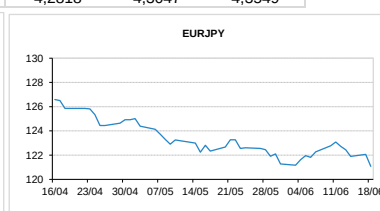


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,29	1,35	-8,97	OT 2Y	-0,398	-0,07	-3,70
JETFUEL	601,66	4,41	-92,09	OT 5Y	-0,147	-0,10	-20,10
DIESEL	566,00	4,50	-93,00	OT 10Y	0,531	-0,11	-51,80
COBRE	5.852,00	23,00	-211,00	BUND 10Y	-0,915	-8,25	-23,60
ZINCO	2.526,00	22,00	-98,50	SCHATZ 2Y	-0,140	-6,63	-12,20
OURO	1.345,72	5,96	69,81	T-NOTE 10Y	2,820	-2,18	-27,90
TRIGO	535,00	-7,75	63,75	T-NOTE 2Y	2,176	-0,77	-30,90
LICENÇA C02	25,19	0,17	0,19	GILT 10Y	0,799	-4,75	-24,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1187	-0,42%	0,18%	1,1269	1,1344	1,1495
EUR/GBP	0,89403	-0,22%	-1,99%	0,8969	0,8999	0,9066
EUR/JPY	121,08	0,81%	1,31%	121,08	121,08	121,08
EUR/CHF	1,1192	0,17%	0,61%	1,1182	1,1171	1,1149
EUR/BRL	4,3162	1,08%	5,97%	4,3817	4,4420	4,5612
EUR/PLN	4,2603	0,03%	0,92%	4,2818	4,3047	4,3549



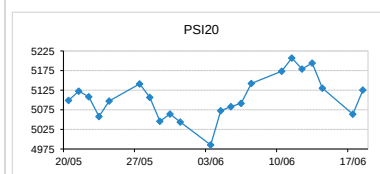
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1187	0,8940	121,08	1,1192	10,6567	7,4672	1,4998	1,6293	4,3162	9,7879
USD	0,8940	-	0,7975	108,515	1,0007	9,5278	6,6760	1,3401	1,4559	3,8583	8,7437

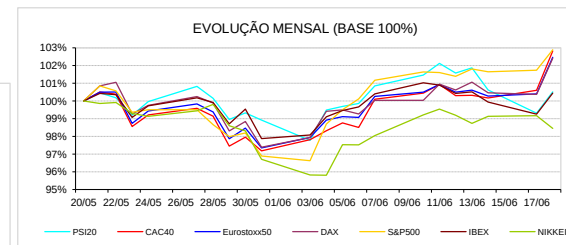
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,165	1,90	6,29
BCP	0,258	2,26	12,29
CORT. AMORIM	10,180	0,20	13,11
CTT	2,108	-0,19	-28,45
EDP	3,460	1,47	13,48
EDP R	9,090	0,00	16,91
GALP	13,105	1,83	-5,00
IBERSOL	8,080	0,00	2,28
J MARTINS	14,545	2,43	40,67
MOTA ENGIL	1,899	3,21	17,95
NAVIGATOR	3,244	1,12	-9,89
NOS	5,715	-0,44	7,93
NOVABASE	2,310	1,76	14,36
PHAROL	0,154	1,45	-5,76
RAMADA	7,600	0,53	1,33
REN	12,000	0,33	-8,40
SEMAPA	0,740	-0,67	-12,84
SONAE CAP.	0,883	0,40	8,95
SONAE SGPS	7,600	0,53	1,33

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	3,21
J MARTINS	2,43
BCP	2,26
ALTRI	1,90
GALP	1,83
CTT	-0,19
NOS	-0,44
SEMAPA	-0,67



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.125,30	1,22%	8,32%	5.686,45	4.551,84
CAC40	5.509,73	2,20%	16,47%	5.601,38	4.555,99
ESTX 50 PR	3.452,89	2,06%	15,04%	3.536,87	2.908,70
XTRA DAX	12.331,75	2,03%	16,79%	12.982,92	10.279,20
S&P 500	2.922,36	1,13%	16,57%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.240,70	1,19%	8,21%	9.971,60	8.286,20
NIKKEI 225	20.972,71	-0,72%	4,79%	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.