

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

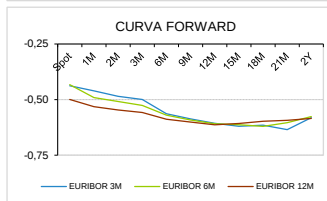
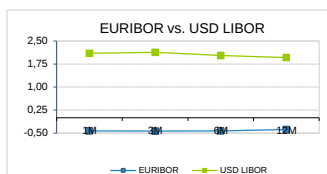
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

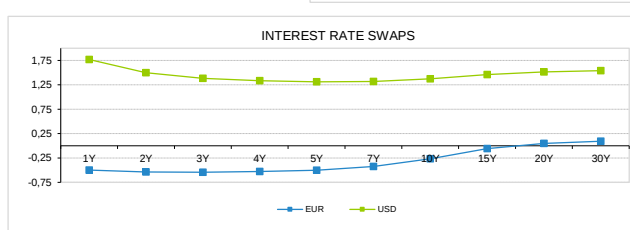
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4270	0	-4	1M	2,1003	-1	-13	0,7066	-0,8904
3M	-0,4330	-1	-6	3M	2,1318	1	-12	0,7549	-0,8588
6M	-0,4280	-1	-7	6M	2,0314	0	-16	0,7795	-0,8464
12M	-0,3830	-1	-8	12M	1,9614	1	-24	0,8389	-0,7520

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4985	1	-9	-0,6183	-0,5165	-0,2956
2Y	-0,5370	1	-10	-0,6044	-0,4698	-0,2257
3Y	-0,5430	1	-12	-0,5715	-0,4146	-0,1590
4Y	-0,5270	2	-15	-0,5335	-0,3457	-0,0902
5Y	-0,5010	2	-18	-0,4903	-0,2817	-0,0310
7Y	-0,4240	2	-24	-0,3729	-0,1552	0,0623
10Y	-0,2670	3	-31	-0,2010	-0,0125	0,1657
15Y	-0,0590	3	-41	-0,0075	0,1207	0,2369
20Y	0,0480	3	-46	0,0841	0,1696	0,2412
30Y	0,0930	3	-49	0,1100	0,1520	0,1832

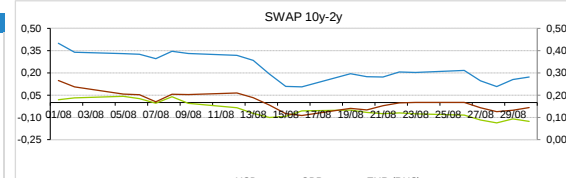
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,00
Austrália	1,00
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7690	-2	-32	1,2603	1,1645	1,3190
2Y	1,4970	-2	-40	1,1975	1,2100	1,3631
3Y	1,3810	-2	-45	1,1780	1,2460	1,3695
4Y	1,3330	-2	-48	1,2050	1,2780	1,4340
5Y	1,3110	-2	-51	1,2175	1,3283	1,4684
7Y	1,3190	-3	-57	1,2800	1,3705	1,5128
10Y	1,3740	-4	-63	1,3670	1,4540	1,5370
15Y	1,4610	-4	-67	1,4495	1,5170	1,5845
20Y	1,5140	-5	-69	1,5025	1,5470	1,5890
30Y	1,5390	-5	-69	1,5240	1,5470	1,5680

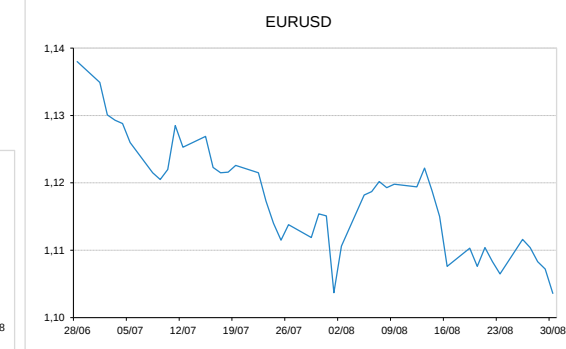
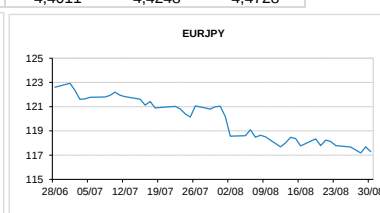


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	60,30	-0,78	-4,33	OT 2Y	-0,640	-0,01	-8,60
JETFUEL	611,50	3,12	-18,50	OT 5Y	-0,340	-0,01	-9,20
DIESEL	576,75	3,87	-13,50	OT 10Y	0,125	0,00	-21,90
COBRE	5.706,50	36,50	-291,50	BUND 10Y	-1,337	-0,79	-26,50
ZINCO	2.273,00	9,50	-201,50	SCHATZ 2Y	-0,270	-1,59	-12,10
OURO	1.527,70	-0,94	98,65	T-NOTE 10Y	2,420	0,00	-36,50
TRIGO	462,00	-10,75	-41,00	T-NOTE 2Y	1,899	0,00	-29,80
LICENÇA C02	26,28	-0,18	-1,62	GILT 10Y	0,482	4,58	-20,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1036	-0,33%	-1,06%	1,1112	1,1188	1,1320
EUR/GBP	0,90565	-0,04%	1,20%	0,9086	0,9117	0,9181
EUR/JPY	117,28	0,34%	3,17%	117,28	117,28	117,28
EUR/CHF	1,0879	0,22%	1,56%	1,0865	1,0849	1,0823
EUR/BRL	4,535	1,68%	-6,75%	4,5974	4,6596	4,7927
EUR/PLN	4,3777	0,28%	-1,82%	4,4011	4,4248	4,4728



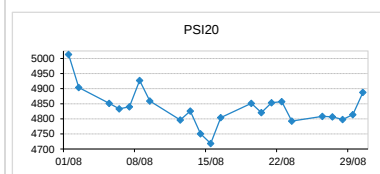
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1036	0,9057	117,28	1,0879	10,8023	7,4561	1,4605	1,63251	4,5350	10,0190
USD	0,9078	-	0,8209	106,16	0,9893	9,8066	6,7688	1,3290	1,4843	4,1347	9,1085

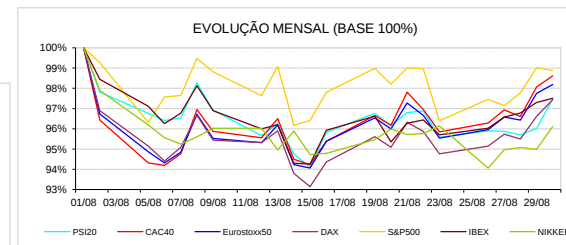
ACCIONISTA

TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,750	2,13	-0,86
BCP	0,193	0,84	-15,82
CORT. AMORIM	9,150	0,55	1,67
CTT	1,880	0,75	-36,18
EDP	3,438	1,09	12,76
EDP R	10,020	2,77	28,87
GALP	13,060	1,91	-5,33
IBERSOL	8,160	0,25	3,29
J MARTINS	15,010	3,06	45,16
MOTA ENGIL	1,894	-0,32	17,64
NAVIGATOR	3,072	1,39	-14,67
NOS	5,345	1,23	0,94
NOVABASE	2,910	2,83	44,06
PHAROL	0,109	0,93	-33,21
RAMADA	6,340	1,28	-15,47
REN	12,060	0,00	-7,94
SEMAPA	0,620	0,49	-26,97
SONAE CAP.	0,825	0,92	1,85
SONAE SGPS	6,340	1,28	-15,47

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
J MARTINS	3,06
NOVABASE	2,83
EDP R	2,77
ALTRI	2,13
GALP	1,91
MOTA ENGIL	-0,32



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.887,63	1,53%	3,30%	5.490,51	4.551,84
CAC40	5.480,48	0,56%	15,85%	5.672,77	4.555,99
ESTX 50 PR	3.426,76	0,45%	14,17%	3.573,57	2.908,70
XTRA DAX	11.939,28	0,85%	13,07%	12.656,05	10.279,20
S&P 500	2.920,45	-0,14%	16,50%	3.027,98	2.346,58
IBEX 35	8.812,90	0,21%	3,20%	9.665,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.704,37	1,19%	3,45%	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.