

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

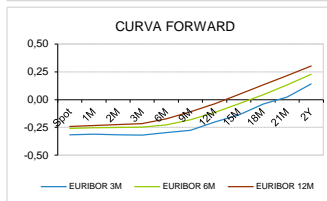
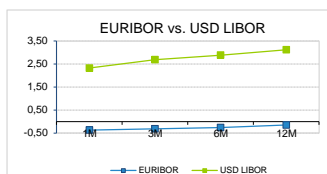
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

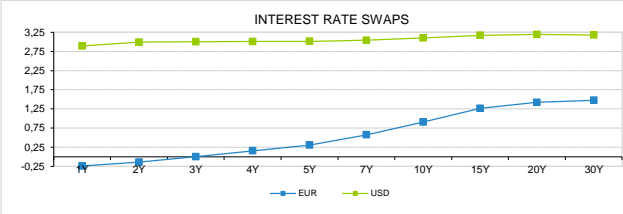
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,3219	1	4	0,7358	-0,7868
3M	-0,3160	0	0	3M	2,6912	0	20	0,8890	-0,7450
6M	-0,2560	0	0	6M	2,8863	0	14	1,0030	-0,6688
12M	-0,1460	0	0	12M	3,1208	1	9	1,1408	-0,5326

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2420	0	0	-0,0373	0,6240	1,1590
2Y	-0,1410	0	-3	0,1320	0,7660	1,2725
3Y	0,0050	0	-5	0,2960	0,8960	1,3755
4Y	0,1580	0	-7	0,4470	1,0170	1,4660
5Y	0,3050	0	-8	0,5875	1,1280	1,5450
7Y	0,5760	0	-8	0,8385	1,3155	1,6700
10Y	0,9090	0	-8	1,1315	1,5131	1,7835
15Y	1,2630	0	-7	1,4124	1,6714	1,8425
20Y	1,4200	0	-6	1,5267	1,7046	1,8115
30Y	1,4770	1	-6	1,5447	1,6595	1,7245

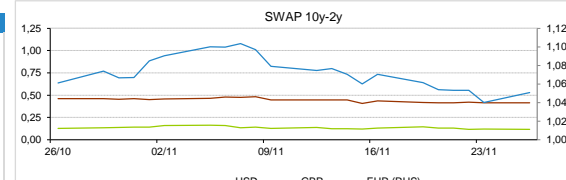
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8940	-1	3	3,1048	3,0469	3,1641
2Y	2,9900	-2	-6	3,0879	3,0580	3,1491
3Y	3,0040	-3	-10	3,0730	3,0615	3,1210
4Y	3,0080	-3	-10	3,0717	3,1020	3,2095
5Y	3,0140	-3	-10	3,0810	3,1045	3,2393
7Y	3,0410	-4	-10	3,0680	3,1824	3,2540
10Y	3,1030	-4	-9	3,1796	3,2370	3,2790
15Y	3,1730	-4	-7	3,2316	3,2668	3,3047
20Y	3,1930	-4	-6	3,2425	3,2624	3,2845
30Y	3,1810	-4	-5	3,1950	3,2295	3,2090

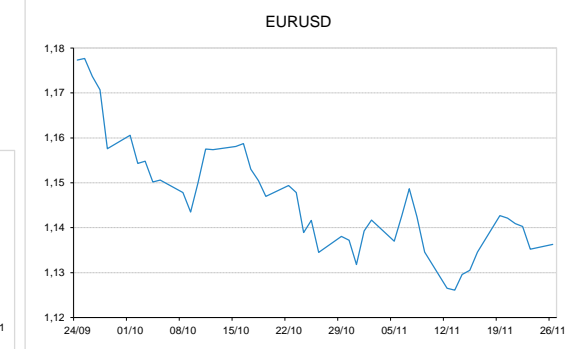
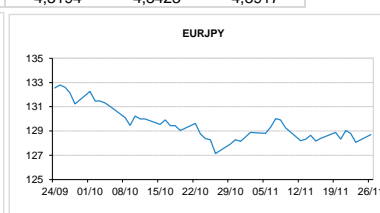


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	60,49	1,69	-17,17	OT 2Y	-0,185	0,00	-6,20
JETFUEL	632,84	12,72	-123,41	OT 5Y	0,681	-0,06	-6,20
DIESEL	592,25	8,50	-126,25	OT 10Y	1,886	-0,06	-5,50
COBRE	6.168,00	-48,00	11,00	BUND 10Y	-0,060	2,24	-4,80
ZINCO	2.569,50	-56,50	-122,00	SCHATZ 2Y	0,021	0,69	1,00
OURO	1.222,36	-1,30	-11,58	T-NOTE 10Y	3,693	1,52	-6,70
TRIGO	511,75	4,50	-12,50	T-NOTE 2Y	3,173	1,57	-5,10
LICENÇA C02	19,84	-0,37	1,56	GILT 10Y	1,528	2,50	-4,20



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1363	0,10%	0,16%	1,1459	1,1549	1,1747
EUR/GBP	0,8844	0,05%	0,27%	0,8876	0,8907	0,8976
EUR/JPY	128,7	-0,49%	-1,22%	128,70	128,70	128,70
EUR/CHF	1,1320	-0,07%	0,50%	1,1307	1,1295	1,1271
EUR/BRL	4,3979	-1,35%	-5,54%	4,4642	4,5288	4,6856
EUR/PLN	4,2951	-0,04%	0,37%	4,3194	4,3423	4,3917



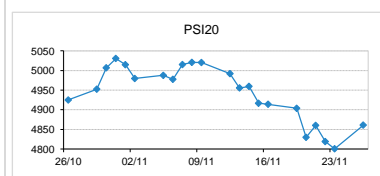
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1363	0,8844	128,70	1,1320	10,3088	7,4616	1,5008	1,5676	4,3979	9,7367
USD	0,8818	-	0,7795	113,575	0,9990	9,0872	6,5792	1,3237	1,3825	3,8808	8,5807

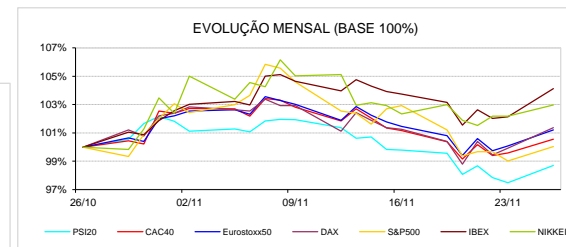
ACCIONISTA

TITULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,710	1,67	29,76
BCP	0,242	2,33	-11,18
CORT. AMORIM	9,330	1,08	-9,42
CTT	3,356	0,48	-4,31
EDP	3,077	1,05	6,66
EDP R	7,625	1,19	9,44
GALP	14,560	1,08	-4,99
IBERSOL	8,100	0,00	-20,00
J MARTINS	10,600	-0,38	-34,55
MOTA ENGIL	1,630	7,24	-55,50
NAVIGATOR	3,700	1,54	-12,33
NOS	5,165	2,08	-5,77
NOVABASE	2,380	0,00	-21,94
PHAROL	0,175	0,00	-30,00
REN	2,408	0,42	-2,86
SEMAPA	14,220	0,85	-20,09
SONAE CAP.	0,763	-0,26	-13,98
SONAE SGPS	0,841	2,25	-25,36

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
MOTA ENGIL	7,24
BCP	2,33
SONAE SGPS	2,25
NOS	2,08
ALTRI	1,67
SONAE CAP.	-0,26
J MARTINS	-0,38



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.860,79	1,25%	-9,79%	5.801,45	4.783,34
CAC40	4.994,98	0,97%	-5,98%	5.657,44	4.894,30
ESTX 50 PR	3.172,71	1,13%	-9,45%	3.687,22	3.090,85
XTRA DAX	11.354,72	1,45%	-12,10%	13.596,89	11.009,25
S&P 500	2.659,83	1,04%	-0,52%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	9.091,20	1,96%	-9,49%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	21.812,00	0,76%	-4,19%	24.448,07	20.347,49



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.