

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

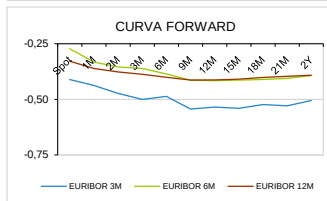
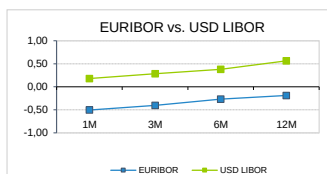
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

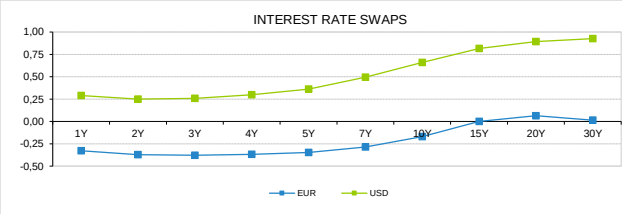
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5040	0	-4	1M	0,1795	-1	1	0,0998	-0,7668
3M	-0,4020	0	-13	3M	0,2838	-1	-9	0,1555	-0,6582
6M	-0,2680	1	-12	6M	0,3794	0	-19	0,3048	-0,6078
12M	-0,1880	0	-11	12M	0,5638	0	-12	0,4761	-0,4606

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3285	0	-10	-0,4129	-0,3392	-0,1803
2Y	-0,3710	0	-8	-0,4023	-0,3050	-0,1351
3Y	-0,3780	0	-7	-0,3824	-0,2635	-0,0897
4Y	-0,3673	-1	-7	-0,3543	-0,2198	-0,0443
5Y	-0,3477	-1	-6	-0,3193	-0,1757	0,0025
7Y	-0,2849	-1	-5	-0,2405	-0,0851	0,0835
10Y	-0,1705	-1	-3	-0,1146	0,0337	0,1692
15Y	-0,0003	-1	-1	0,0378	0,1254	0,1991
20Y	0,0640	-2	1	0,0797	0,1206	0,1489
30Y	0,0146	-3	4	0,0137	0,0245	0,0286

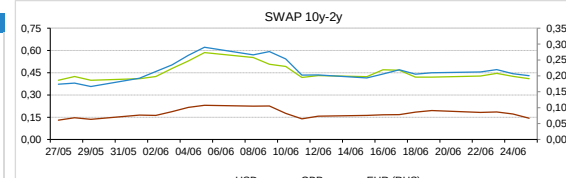
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,25
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2895	1	-2	0,2151	0,4226	0,7771
2Y	0,2500	0	-1	0,2432	0,5090	0,8353
3Y	0,2578	0	-1	0,3014	0,6013	0,8871
4Y	0,2976	0	-1	0,3791	0,6771	0,9316
5Y	0,3610	0	-1	0,4480	0,7300	0,9687
7Y	0,4948	-1	-1	0,5940	0,8358	1,0196
10Y	0,6595	-2	0	0,7447	0,9140	1,0576
15Y	0,8166	-3	1	0,8725	0,9860	1,0850
20Y	0,8932	-4	2	0,9299	1,0050	1,0580
30Y	0,9261	-5	0	0,9370	0,9860	1,0127

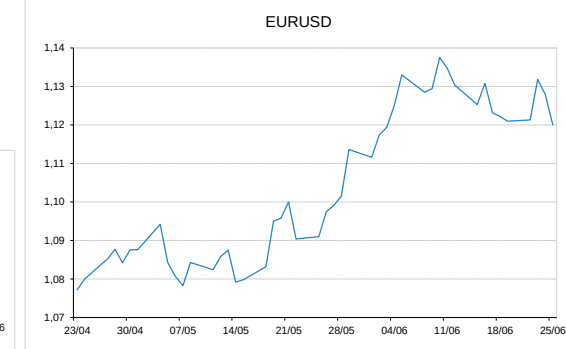
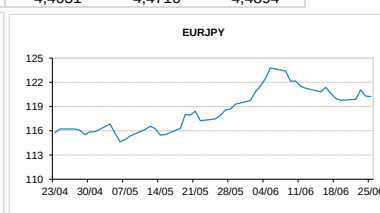


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	40,40	0,09	4,28	OT 2Y	-0,471	-0,01	-10,60
JETFUEL	323,38	-4,12	35,62	OT 5Y	-0,094	0,00	-22,20
DIESEL	344,03	-2,72	46,53	OT 10Y	0,463	0,01	-22,40
COBRE	5.889,00	-40,00	576,50	BUND 10Y	-1,169	-3,40	-8,00
ZINCO	2.029,50	-3,25	45,25	SCHATZ 2Y	-0,066	-1,60	-2,90
OURO	1.761,49	-5,06	33,39	T-NOTE 10Y	1,739	-0,70	-2,40
TRIGO	487,00	1,25	-25,75	T-NOTE 2Y	0,768	-0,93	1,10
LICENÇA C02	25,17	-0,23	3,58	GILT 10Y	0,183	-4,22	-6,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,12	-0,71%	2,66%	1,1223	1,1247	1,1298
EUR/GBP	0,90133	0,23%	-0,69%	0,9027	0,9043	0,9076
EUR/JPY	120,25	0,04%	-2,31%	120,25	120,25	120,25
EUR/CHF	1,0640	0,39%	-0,55%	1,0633	1,0626	1,0613
EUR/BRL	6,0106	0,04%	-1,26%	6,0380	6,0644	6,1396
EUR/PLN	4,4554	0,01%	1,07%	4,4631	4,4716	4,4894



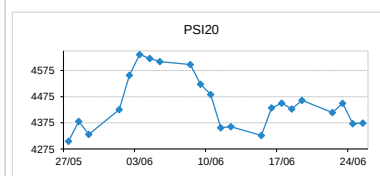
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1200	0,9013	120,25	1,0640	10,4772	7,4547	1,5321	1,63369	6,0106	10,8816
USD	0,8917	-	0,8061	107,175	0,9488	9,3431	6,6474	1,3652	1,4577	5,3306	9,7042

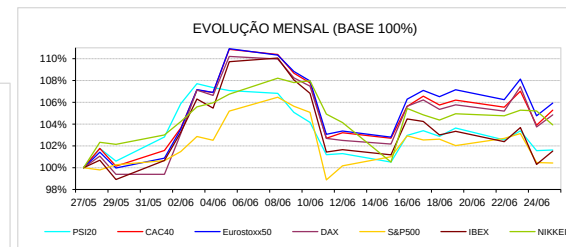
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,136	-1,52	-27,18
BCP	0,110	-0,54	-45,81
CORT. AMORIM	9,840	-1,01	-12,92
CTT	2,110	-1,40	-33,86
EDP	4,192	1,72	8,49
EDP R	11,740	0,86	11,81
GALP	10,635	0,52	-28,62
IBERSOL	5,220	-5,09	-34,75
J MARTINS	15,745	-0,32	7,36
MOTA ENGIL	1,148	0,35	-38,61
NAVIGATOR	2,122	-3,11	-38,47
NOS	3,836	0,95	-20,08
PHAROL	0,105	-1,69	5,22
RAMADA	4,060	-1,22	-30,48
REN	2,430	0,21	-10,66
SEMAPA	8,100	-1,82	-40,96
SONAE CAP.	0,520	-1,89	-30,94
SONAE SGPS	0,635	0,24	-30,22

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP	1,72
NOS	0,95
EDP R	0,86
GALP	0,52
MOTA ENGIL	0,35
PHAROL	-1,69
SEMAPA	-1,82
SONAE CAP.	-1,89
NAVIGATOR	-3,11
IBERSOL	-5,09



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.374,12	0,05%	-16,11%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.935,90	1,32%	-17,43%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.231,73	1,11%	-13,71%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.222,37	1,06%	-7,75%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.048,36	-0,04%	-5,63%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.284,20	1,23%	-23,72%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.259,79	-1,22%	-5,90%	24.115,95	16.358,19



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.