

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

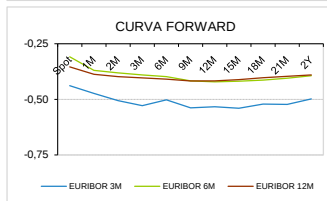
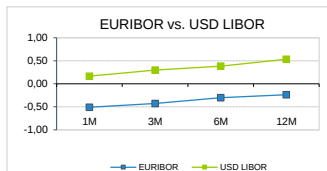
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

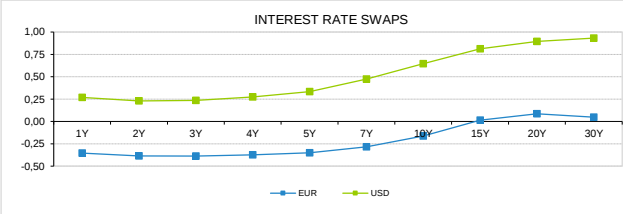
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5090	0	-3	1M	0,1663	0	-1	0,0841	-0,7798
3M	-0,4290	-1	-10	3M	0,2985	0	-4	0,1509	-0,6772
6M	-0,3020	-1	-12	6M	0,3843	2	-11	0,2734	-0,6288
12M	-0,2370	0	-13	12M	0,5333	-1	-10	0,4265	-0,4714

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,3540	-1	-10	-0,4167	-0,3323	-0,1687	
2Y	-0,3849	-1	-8	-0,4034	-0,2957	-0,1228	
3Y	-0,3873	-1	-8	-0,3796	-0,2536	-0,0733	
4Y	-0,3728	-1	-8	-0,3506	-0,2093	-0,0272	
5Y	-0,3499	-2	-8	-0,3141	-0,1622	0,0220	
7Y	-0,2839	-2	-8	-0,2314	-0,0696	0,1037	
10Y	-0,1628	-3	-7	-0,1005	0,0523	0,1920	
15Y	0,0141	-3	-5	0,0578	0,1524	0,2291	
20Y	0,0855	-2	-5	0,1059	0,1523	0,1832	
30Y	0,0480	-2	-5	0,0493	0,0639	0,0703	

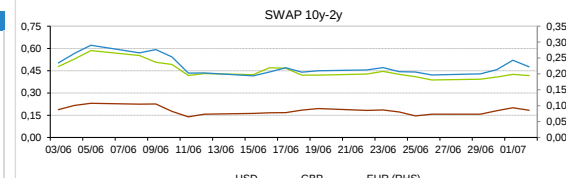
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,25
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2694	0	-2	0,1903	0,3913	0,7687
2Y	0,2292	0	-2	0,2203	0,4831	0,8340
3Y	0,2361	0	-2	0,2749	0,5762	0,8891
4Y	0,2744	0	-3	0,3513	0,6565	0,9318
5Y	0,3342	0	-3	0,4315	0,7254	0,9693
7Y	0,4746	-1	-3	0,5772	0,8285	1,0270
10Y	0,6461	-1	-2	0,7250	0,9259	1,0661
15Y	0,8131	-1	-4	0,8718	1,0015	1,0970
20Y	0,8950	-1	-5	0,9357	1,0223	1,0846
30Y	0,9320	-1	-6	0,9440	0,9970	1,0256

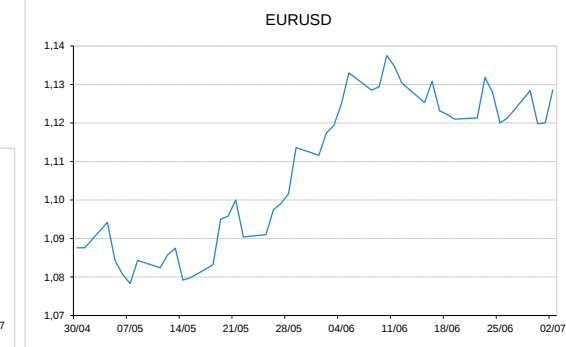
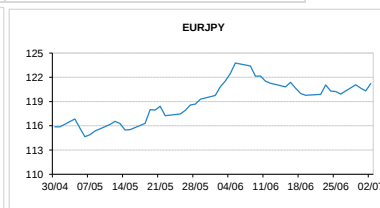
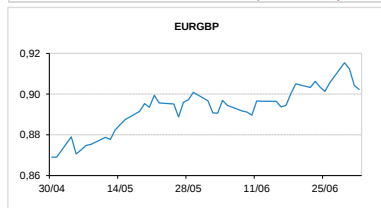


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	42,58	0,55	2,92	OT 2Y	-0,477	-0,02	-7,60
JETFUEL	346,83	5,94	41,75	OT 5Y	-0,083	-0,02	-8,50
DIESEL	368,54	6,90	46,96	OT 10Y	0,439	-0,03	-7,20
COBRE	6.056,00	46,00	577,00	BUND 10Y	-1,131	-4,43	-6,60
ZINCO	2.031,50	-6,75	13,00	SCHATZ 2Y	-0,039	-1,60	-1,10
OURO	1.778,35	7,56	53,50	T-NOTE 10Y	1,731	-0,84	-1,70
TRIGO	492,50	-6,25	-19,75	T-NOTE 2Y	0,756	-0,56	-0,40
LICENÇA C02	27,55	-0,16	5,48	GILT 10Y	0,216	-2,87	-4,20



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1286	0,77%	1,00%	1,1309	1,1336	1,1383
EUR/GBP	0,90225	0,23%	-1,27%	0,9036	0,9052	0,9083
EUR/JPY	121,24	-0,77%	-0,34%	121,24	121,24	121,24
EUR/CHF	1,0624	0,26%	1,17%	1,0617	1,0608	1,0595
EUR/BRL	5,9691	0,29%	-2,64%	6,0286	6,0644	6,1344
EUR/PLN	4,4627	0,37%	-1,66%	4,4705	4,4797	4,4973



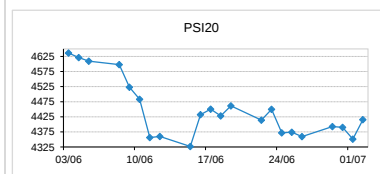
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1286	0,9023	121,24	1,0624	10,4717	7,4523	1,5273	1,62452	5,9691	10,7145
USD	0,8905	-	0,8022	107,625	0,9458	9,3248	6,6361	1,3608	1,4468	5,3384	9,5379

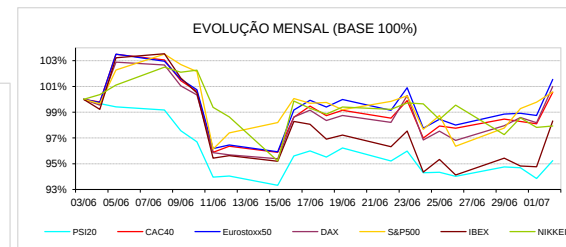
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,288	1,85	-24,51
BCP	0,108	1,98	-46,60
CORT. AMORIM	10,140	-0,59	-10,27
CTT	2,115	0,95	-33,70
EDP	4,459	3,82	15,40
EDP R	12,660	1,77	20,57
GALP	10,480	1,85	-29,66
IBERSOL	5,200	0,39	-35,00
J MARTINS	15,095	-0,20	2,93
MOTA ENGIL	1,150	2,31	-38,50
NAVIGATOR	2,178	1,59	-36,84
NOS	3,646	0,39	-24,04
PHAROL	0,102	0,79	2,21
RAMADA	3,810	0,00	-34,76
REN	2,470	1,23	-9,19
SEMAPA	8,280	1,97	-39,65
SONAE CAP.	0,510	0,00	-32,27
SONAE SGPS	0,640	0,79	-29,67

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP	3,82
MOTA ENGIL	2,31
BCP	1,98
SEMAPA	1,97
ALTRI	1,85
J MARTINS	-0,20
CORT. AMORIM	-0,59



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.415,52	1,48%	-15,32%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.049,58	2,49%	-15,53%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.320,15	2,84%	-11,35%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.611,08	2,86%	-4,81%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.140,73	0,78%	-2,80%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.497,80	3,74%	-21,48%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.145,96	0,11%	-6,39%	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.