

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

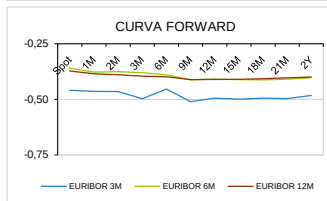
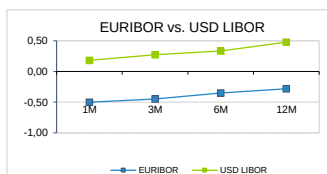
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

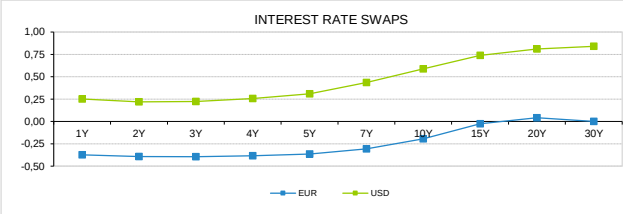
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5010	1	-2	1M	0,1809	0	-1	0,0691	-0,7716
3M	-0,4490	-1	-8	3M	0,2729	0	-3	0,0824	-0,6900
6M	-0,3520	-2	-15	6M	0,3346	-1	-10	0,2080	-0,6470
12M	-0,2820	-1	-15	12M	0,4769	0	-11	0,3503	-0,5204

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3738	-1	-9	-0,4103	-0,3558	-0,2065
2Y	-0,3927	-1	-7	-0,4082	-0,3247	-0,1615
3Y	-0,3945	-1	-6	-0,3891	-0,2847	-0,1150
4Y	-0,3838	-1	-6	-0,3660	-0,2424	-0,0716
5Y	-0,3640	-1	-7	-0,3337	-0,1981	-0,0270
7Y	-0,3060	-1	-7	-0,2574	-0,1113	0,0554
10Y	-0,1940	-1	-8	-0,1355	0,0081	0,1407
15Y	-0,0260	-1	-8	0,0156	0,1018	0,1752
20Y	0,0413	0	-8	0,0604	0,1007	0,1287
30Y	0,0000	0	-8	0,0008	0,0148	0,0221

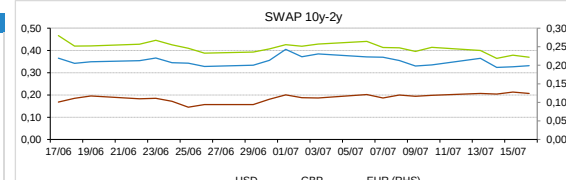
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,25
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2514	-1	-5	0,1843	0,3599	0,6914
2Y	0,2188	-1	-5	0,2049	0,4387	0,7360
3Y	0,2237	-1	-6	0,2578	0,5070	0,7870
4Y	0,2567	-1	-7	0,3241	0,5825	0,8433
5Y	0,3097	-1	-8	0,3965	0,6445	0,8758
7Y	0,4345	-1	-12	0,5165	0,7390	0,9150
10Y	0,5885	-2	-15	0,6681	0,8210	0,9500
15Y	0,7380	-2	-18	0,7810	0,8960	0,9680
20Y	0,8111	-2	-19	0,8459	0,9218	0,9560
30Y	0,8400	-2	-21	0,8490	0,8913	0,9109

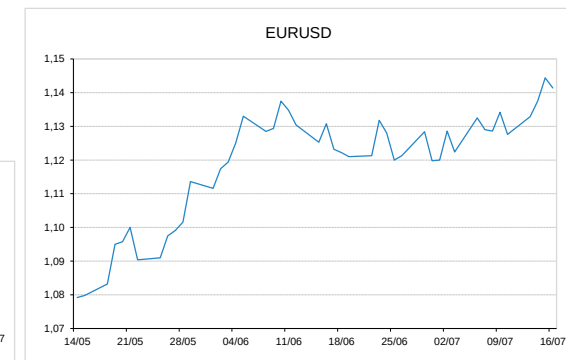
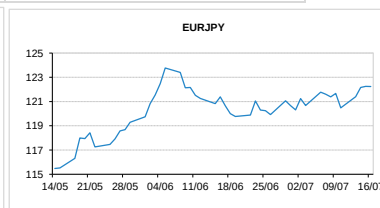
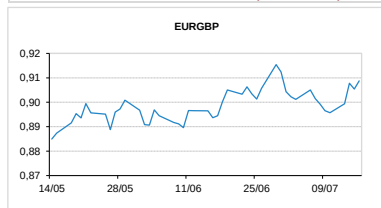


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	43,62	-0,17	2,49	OT 2Y	-0,428	0,00	-3,50
JETFUEL	351,92	6,68	28,17	OT 5Y	-0,098	-0,02	-9,70
DIESEL	375,17	7,92	36,42	OT 10Y	0,419	-0,01	-11,10
COBRE	6.394,50	-112,50	678,50	BUND 10Y	-1,168	-2,60	-7,40
ZINCO	2.194,75	7,25	215,00	SCHATZ 2Y	-0,041	-1,37	-1,10
OURO	1.806,53	-6,08	77,50	T-NOTE 10Y	1,689	-1,54	-9,70
TRIGO	536,25	-14,50	35,00	T-NOTE 2Y	0,739	-0,93	-5,20
LICENÇA C02	26,67	-2,18	3,89	GILT 10Y	0,167	-2,95	-5,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1414	-0,26%	0,94%	1,1437	1,1464	1,1507
EUR/GBP	0,90875	-0,37%	-1,66%	0,9101	0,9116	0,9143
EUR/JPY	122,24	0,01%	-0,70%	122,24	122,24	122,24
EUR/CHF	1,0782	-0,04%	-0,62%	1,0775	1,0767	1,0751
EUR/BRL	6,1073	0,32%	-3,38%	6,1377	6,1678	6,2419
EUR/PLN	4,4773	0,00%	-0,68%	4,4841	4,4925	4,5093



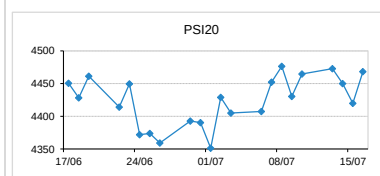
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1414	0,9088	122,24	1,0782	10,3309	7,4460	1,5475	1,6314	6,1073	10,5791
USD	0,8748	-	0,7939	107,125	0,9436	9,0425	6,5124	1,3532	1,4285	5,3535	9,2613

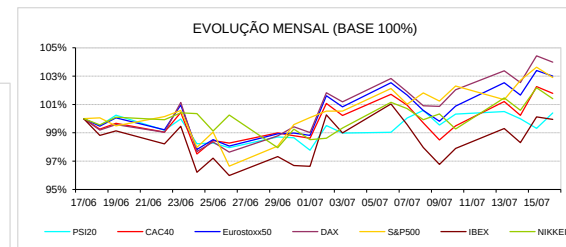
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,336	-0,23	-23,66
BCP	0,109	0,83	-46,06
CORT. AMORIM	9,840	-1,40	-12,92
CTT	2,245	1,81	-29,62
EDP	4,471	2,31	15,71
EDP R	13,800	3,29	31,43
GALP	10,450	0,00	-29,87
IBERSOL	5,700	0,00	-28,75
J MARTINS	14,855	-1,00	1,30
MOTA ENGIL	1,230	0,99	-34,22
NAVIGATOR	2,186	-0,18	-36,61
NOS	3,584	2,93	-25,33
PHAROL	0,100	-0,99	0,20
RAMADA	3,360	-2,33	-42,47
REN	2,495	1,01	-8,27
SEMAPA	8,180	-0,24	-40,38
SONAE CAP.	0,508	0,40	-32,54
SONAE SGPS	0,654	1,40	-28,13

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP R	3,29
NOS	2,93
EDP	2,31
CTT	1,81
SONAE SGPS	1,40
SEMAPA	-0,24
PHAROL	-0,99
J MARTINS	-1,00
CORT. AMORIM	-1,40
RAMADA	-2,33



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.468,22	1,09%	-14,31%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.085,28	-0,46%	-14,93%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.365,35	-0,38%	-10,14%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.874,97	-0,43%	-2,82%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.203,49	-0,70%	-0,83%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.474,70	-0,17%	-21,72%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.770,36	-0,76%	-3,75%	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.