

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

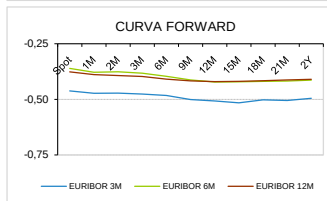
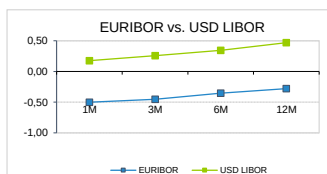
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

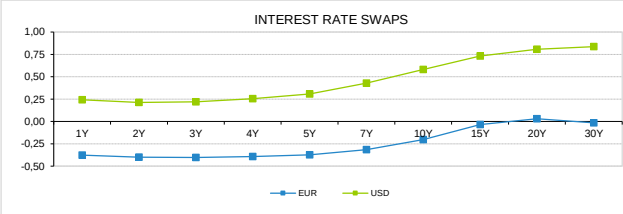
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5010	0	1	1M	0,1756	0	-1	0,0650	-0,7760
3M	-0,4520	-1	-5	3M	0,2578	-1	-5	0,0760	-0,6940
6M	-0,3530	-1	-12	6M	0,3428	1	-7	0,1839	-0,6508
12M	-0,2800	0	-11	12M	0,4685	0	-11	0,3245	-0,5216

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3769	-1	-5	-0,4203	-0,3597	-0,2190
2Y	-0,3994	-1	-2	-0,4151	-0,3286	-0,1720
3Y	-0,4030	-1	-2	-0,3967	-0,2930	-0,1250
4Y	-0,3923	-1	-2	-0,3718	-0,2507	-0,0810
5Y	-0,3734	-1	-3	-0,3423	-0,2068	-0,0323
7Y	-0,3152	-1	-3	-0,2662	-0,1190	0,0460
10Y	-0,2035	-1	-4	-0,1433	0,0003	0,1320
15Y	-0,0347	-1	-4	0,0071	0,0924	0,1628
20Y	0,0300	-1	-5	0,0485	0,0886	0,1151
30Y	-0,0148	-1	-6	-0,0129	-0,0022	0,0027

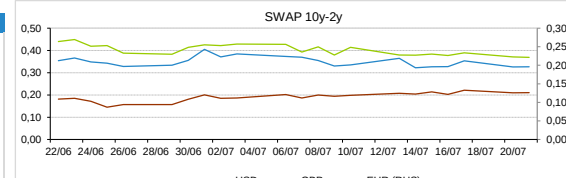
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,25
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2415	-1	-5	0,1791	0,3612	0,6795
2Y	0,2122	-1	-4	0,2078	0,4402	0,7260
3Y	0,2200	-1	-4	0,2581	0,5090	0,7745
4Y	0,2544	-1	-6	0,3200	0,5780	0,8274
5Y	0,3076	-1	-7	0,3872	0,6385	0,8632
7Y	0,4289	-1	-9	0,5197	0,7337	0,9040
10Y	0,5811	-1	-11	0,6599	0,8180	0,9420
15Y	0,7321	-1	-13	0,7750	0,8870	0,9685
20Y	0,8067	-1	-13	0,8330	0,9090	0,9580
30Y	0,8365	-1	-14	0,8500	0,8908	0,9131

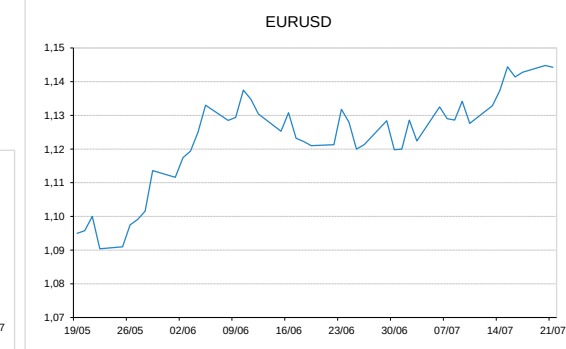
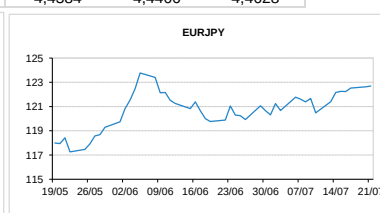


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	44,66	1,38	2,52	OT 2Y	-0,455	-0,01	-4,20
JETFUEL	354,00	4,25	7,50	OT 5Y	-0,147	0,00	-11,40
DIESEL	376,25	5,00	15,75	OT 10Y	0,360	-0,01	-14,90
COBRE	6.474,50	39,50	638,00	BUND 10Y	-1,158	0,07	-4,50
ZINCO	2.195,25	19,00	114,10	SCHATZ 2Y	-0,030	0,23	1,60
OURO	1.839,89	22,12	96,02	T-NOTE 10Y	1,686	-1,40	-6,90
TRIGO	531,25	9,25	46,00	T-NOTE 2Y	0,739	-0,74	-3,90
LICENÇA C02	26,73	0,56	2,57	GILT 10Y	0,164	-1,18	-10,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1443	-0,04%	2,05%	1,1466	1,1494	1,1537
EUR/GBP	0,90055	0,58%	0,30%	0,9019	0,9034	0,9061
EUR/JPY	122,7	-0,06%	-2,29%	122,70	122,70	122,70
EUR/CHF	1,0740	0,08%	-0,63%	1,0733	1,0725	1,0710
EUR/BRL	5,9657	2,32%	-0,74%	5,9931	6,0230	6,0969
EUR/PLN	4,4320	0,53%	0,27%	4,4384	4,4466	4,4628



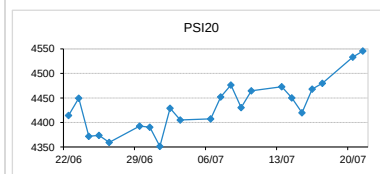
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1443	0,9006	122,70	1,0740	10,2298	7,4431	1,5452	1,61598	5,9657	10,4871
USD	0,8705	-	0,7845	106,875	0,9361	8,9062	6,4794	1,3447	1,4072	5,2170	9,1353

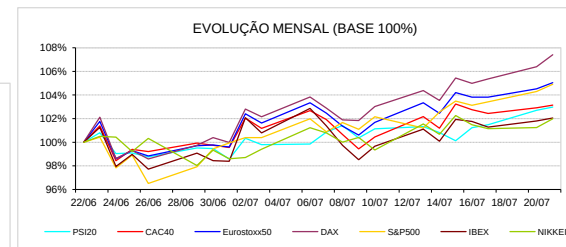
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,458	0,36	-21,51
BCP	0,109	-0,73	-46,20
CORT. AMORIM	9,960	2,15	-11,86
CTT	2,330	-0,21	-26,96
EDP	4,549	0,27	20,46
EDP R	14,180	-0,42	35,05
GALP	10,620	2,76	-28,72
IBERSOL	5,680	0,00	-29,00
J MARTINS	14,800	-1,04	0,92
MOTA ENGIL	1,242	0,98	-33,58
NAVIGATOR	2,254	0,81	-34,64
NOS	3,672	0,05	-23,50
PHAROL	0,110	-2,84	10,04
RAMADA	3,420	0,59	-41,44
REN	2,490	0,00	-8,46
SEMAPA	8,350	0,24	-39,14
SONAE CAP.	0,508	1,60	-32,54
SONAE SGPS	0,657	-0,15	-27,80

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
GALP	2,76
CORT. AMORIM	2,15
SONAE CAP.	1,60
MOTA ENGIL	0,98
NAVIGATOR	0,81
CTT	-0,21
EDP R	-0,42
BCP	-0,73
J MARTINS	-1,04
PHAROL	-2,84



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.545,81	0,27%	-12,82%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.104,28	0,22%	-14,62%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.405,29	0,50%	-9,07%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.171,83	0,96%	-0,58%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.270,92	0,59%	1,24%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.496,20	0,24%	-21,50%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.884,22	0,73%	-3,27%	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.