

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

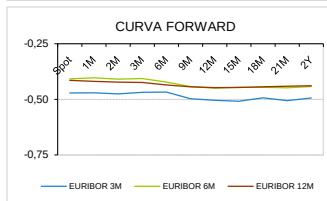
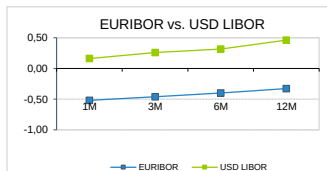
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

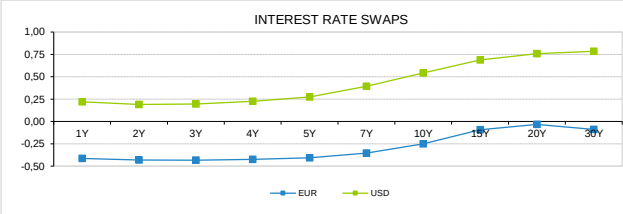
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5190	0	-1	1M	0,1611	-1	-1	0,0649	-0,7852
3M	-0,4610	0	-4	3M	0,2606	-1	-4	0,1065	-0,7082
6M	-0,3990	-1	-9	6M	0,3155	0	-5	0,1703	-0,6582
12M	-0,3280	-1	-10	12M	0,4611	0	-9	0,3109	-0,5278

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4145	-1	-6	-0,4473	-0,3960	-0,2747
2Y	-0,4310	-2	-4	-0,4443	-0,3668	-0,2332
3Y	-0,4335	-2	-4	-0,4282	-0,3357	-0,1915
4Y	-0,4240	-3	-5	-0,4066	-0,2991	-0,1494
5Y	-0,4062	-3	-5	-0,3801	-0,2608	-0,1020
7Y	-0,3549	-3	-7	-0,3136	-0,1779	-0,0243
10Y	-0,2515	-3	-8	-0,1982	-0,0650	0,0590
15Y	-0,0921	-4	-10	-0,0564	0,0241	0,0867
20Y	-0,0335	-4	-11	-0,0199	0,0129	0,0347
30Y	-0,0887	-4	-12	-0,0910	-0,0837	-0,0824

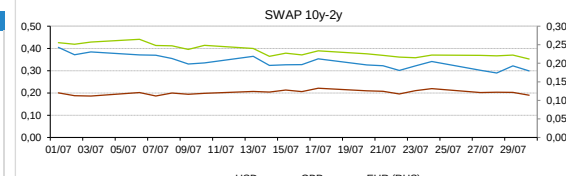
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,25
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2201	-2	-5	0,1617	0,3198	0,6355
2Y	0,1900	-2	-3	0,1826	0,3910	0,6830
3Y	0,1943	-2	-3	0,2253	0,4739	0,7350
4Y	0,2244	-2	-4	0,2886	0,5430	0,7750
5Y	0,2739	-2	-5	0,3475	0,5939	0,8186
7Y	0,3925	-3	-7	0,4799	0,6775	0,8490
10Y	0,5424	-4	-9	0,6200	0,7655	0,8840
15Y	0,6875	-4	-11	0,7394	0,8315	0,9100
20Y	0,7574	-4	-12	0,7790	0,8490	0,8960
30Y	0,7846	-5	-13	0,7950	0,8334	0,8545

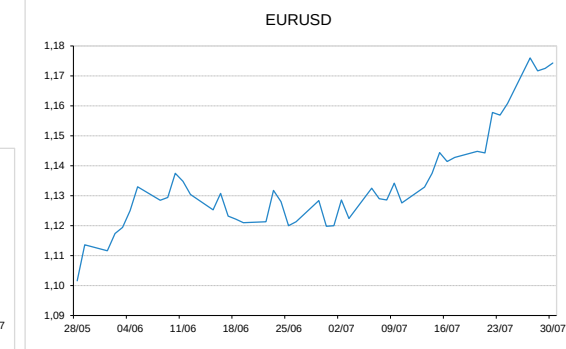
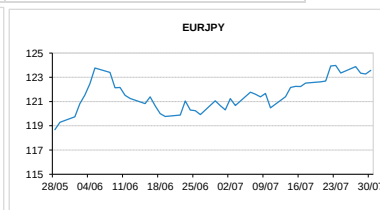
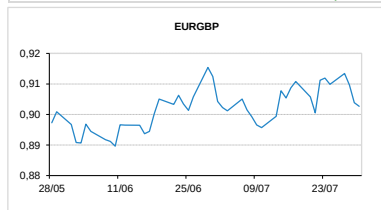


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	42,72	-1,03	1,45	OT 2Y	-0,459	-0,02	1,00
JETFUEL	354,75	5,75	25,60	OT 5Y	-0,204	-0,03	-12,00
DIESEL	381,25	5,75	30,50	OT 10Y	0,319	-0,04	-15,70
COBRE	6.476,00	-3,00	512,50	BUND 10Y	-1,245	-4,77	-7,60
ZINCO	2.294,00	49,75	237,25	SCHATZ 2Y	-0,073	-2,75	-0,90
OURO	1.948,51	-11,85	164,83	T-NOTE 10Y	1,650	-1,81	-7,00
TRIGO	531,50	-1,25	39,75	T-NOTE 2Y	0,720	-0,55	-2,40
LICENÇA C02	25,49	-0,70	-1,48	GILT 10Y	0,112	-3,18	-8,50



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1743	0,15%	4,87%	1,1766	1,1792	1,1835
EUR/GBP	0,90268	0,13%	1,08%	0,9040	0,9054	0,9082
EUR/JPY	123,58	-0,24%	-2,36%	123,58	123,58	123,58
EUR/CHF	1,0751	0,03%	-0,96%	1,0744	1,0735	1,0721
EUR/BRL	6,1115	-0,26%	0,49%	6,1343	6,1660	6,2363
EUR/PLN	4,4164	0,00%	0,67%	4,4219	4,4289	4,4442



FIXINGS CONTRA USD e EUR

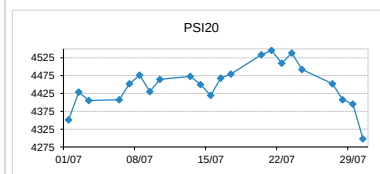
	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1743	0,9027	123,58	1,0751	10,3149	7,4428	1,5831	1,65108	6,1115	10,7717
USD	0,8480	-	0,7665	105,025	0,9119	8,7571	6,3109	1,3444	1,4024	5,1857	9,1514

ACCIONISTA

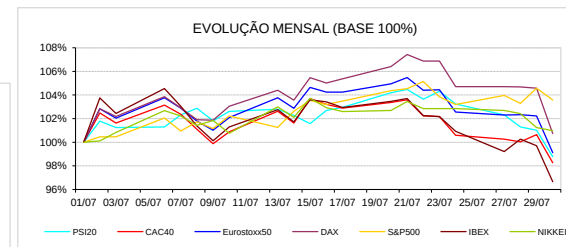
TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,270	-0,19	-24,82
BCP	0,097	-2,80	-52,02
CORT. AMORIM	9,780	-1,01	-13,45
CTT	2,260	-2,16	-29,15
EDP	4,267	-1,02	12,99
EDP R	13,820	-1,29	31,62
GALP	9,066	-3,53	-39,13
IBERSOL	5,440	-2,51	-32,00
J MARTINS	14,175	-3,77	-3,27
MOTA ENGIL	1,154	-3,03	-38,29
NAVIGATOR	2,154	-2,09	-37,42
NOS	3,812	-2,41	-20,58
PHAROL	0,119	-2,78	19,28
RAMADA	3,130	-2,49	-46,40
REN	2,425	-2,02	-10,85
SEMAPA	7,710	-2,77	-43,80
SONAE CAP.	0,472	-1,67	-37,32
SONAE SGPS	0,590	-2,88	-35,16

MAIORES GANHOS/PERDAS

Título	Variação %
BCP	-2,80
SONAE SGPS	-2,88
MOTA ENGIL	-3,03
GALP	-3,53
J MARTINS	-3,77



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.297,91	-2,22%	-17,57%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.841,28	-2,37%	-19,02%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.199,94	-3,04%	-14,56%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.347,97	-3,67%	-6,77%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.227,45	-0,95%	-0,11%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.986,10	-3,06%	-26,85%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.339,23	-0,26%	-5,57%	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.