

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

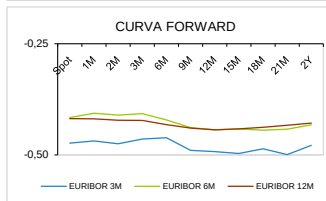
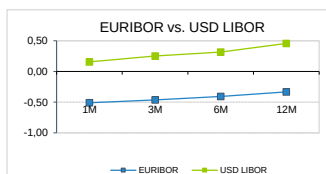
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

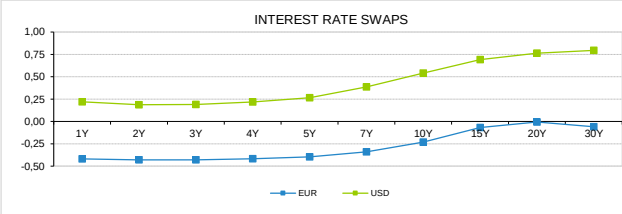
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5100	1	0	1M	0,1556	-1	-1	0,0643	-0,7804
3M	-0,4630	0	-4	3M	0,2510	-1	-5	0,0821	-0,7066
6M	-0,4070	-1	-10	6M	0,3149	0	-5	0,1618	-0,6598
12M	-0,3330	-1	-11	12M	0,4565	0	-9	0,3114	-0,5300

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4185	0	-6	-0,4435	-0,3819	-0,2442
2Y	-0,4300	0	-4	-0,4358	-0,3478	-0,2034
3Y	-0,4295	0	-4	-0,4186	-0,3132	-0,1610
4Y	-0,4170	1	-4	-0,3920	-0,2752	-0,1172
5Y	-0,3955	1	-4	-0,3622	-0,2352	-0,0706
7Y	-0,3400	2	-5	-0,2921	-0,1505	0,0051
10Y	-0,2320	2	-6	-0,1738	-0,0369	0,0907
15Y	-0,0680	3	-7	-0,0295	0,0521	0,1198
20Y	-0,0063	3	-8	0,0102	0,0468	0,0688
30Y	-0,0600	3	-9	-0,0613	-0,0529	-0,0523

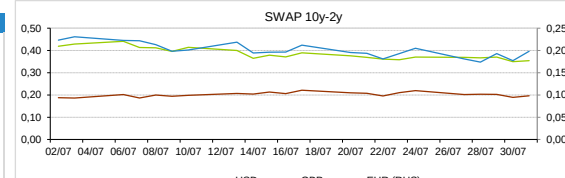
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,25
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2191	0	-5	0,1567	0,3056	0,6165
2Y	0,1869	0	-4	0,1648	0,3780	0,6850
3Y	0,1889	-1	-4	0,2157	0,4550	0,7357
4Y	0,2174	-1	-4	0,2750	0,5340	0,7850
5Y	0,2657	-1	-5	0,3430	0,5952	0,8191
7Y	0,3869	0	-7	0,4587	0,6710	0,8728
10Y	0,5410	0	-9	0,6105	0,7846	0,8975
15Y	0,6912	1	-11	0,7320	0,8523	0,9215
20Y	0,7630	1	-11	0,7711	0,8683	0,9090
30Y	0,7946	1	-12	0,7990	0,8450	0,8688

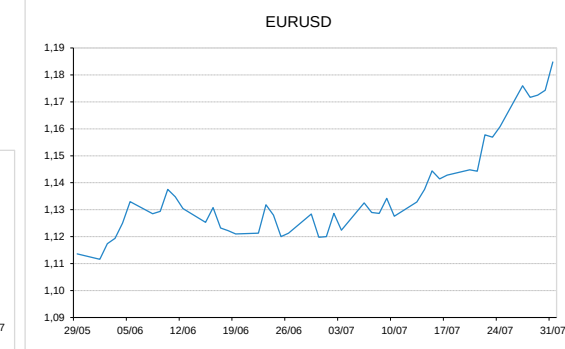
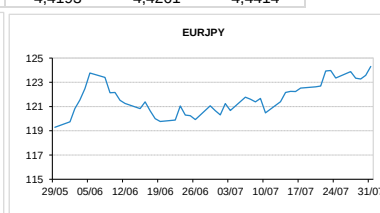
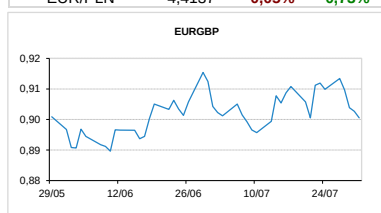


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	43,15	0,21	1,88	OT 2Y	-0,450	0,01	0,90
JETFUEL	339,75	-15,00	6,29	OT 5Y	-0,184	0,02	-12,50
DIESEL	368,00	-13,25	11,50	OT 10Y	0,347	0,03	-12,60
COBRE	6.455,50	-43,50	415,50	BUND 10Y	-1,233	1,39	-14,70
ZINCO	2.282,50	-11,50	240,50	SCHATZ 2Y	-0,073	0,23	-5,00
OURO	1.975,91	26,33	192,23	T-NOTE 10Y	1,641	-0,28	-9,80
TRIGO	532,25	2,75	40,50	T-NOTE 2Y	0,719	-0,18	-4,20
LICENÇA C02	26,32	0,78	-0,65	GILT 10Y	0,126	1,34	-11,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1848	0,89%	5,80%	1,1871	1,1897	1,1940
EUR/GBP	0,90053	0,24%	1,32%	0,9019	0,9033	0,9061
EUR/JPY	124,31	-0,59%	-2,94%	124,31	124,31	124,31
EUR/CHF	1,0775	-0,15%	-1,18%	1,0767	1,0759	1,0745
EUR/BRL	6,1486	-0,66%	-0,10%	6,1764	6,2050	6,2750
EUR/PLN	4,4137	-0,05%	0,73%	4,4193	4,4261	4,4414



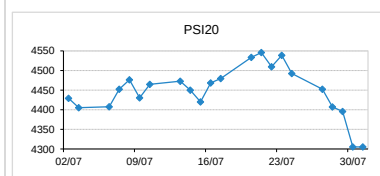
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1848	0,9005	124,31	1,0775	10,3411	7,4456	1,5817	1,65065	6,1486	10,7379
USD	0,8454	-	0,7618	105,68	0,9095	8,7386	6,2960	1,3401	1,3946	5,2128	9,0802

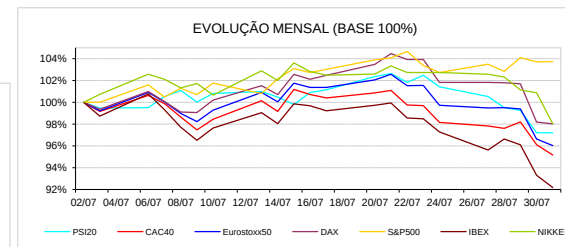
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,218	-1,31	-25,74
BCP	0,099	0,72	-51,38
CORT. AMORIM	9,900	1,02	-12,39
CTT	2,275	0,66	-28,68
EDP	4,287	-0,16	13,52
EDP R	13,940	0,58	32,76
GALP	8,918	-1,87	-40,15
IBERSOL	5,460	0,00	-31,75
J MARTINS	14,280	0,67	-2,63
MOTA ENGIL	1,172	1,74	-37,33
NAVIGATOR	2,126	-1,39	-38,35
NOS	3,762	-1,16	-21,63
PHAROL	0,119	0,51	19,08
RAMADA	3,180	1,60	-45,55
REN	2,445	0,82	-10,11
SEMAPA	7,680	-0,13	-44,02
SONAE CAP.	0,473	-0,84	-37,18
SONAE SGPS	0,597	1,36	-34,40

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	1,74
RAMADA	1,60
SONAE SGPS	1,36
CORT. AMORIM	1,02
REN	0,82
SONAE CAP.	-0,84
NOS	-1,16
ALTRI	-1,31
NAVIGATOR	-1,39
GALP	-1,87



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.305,10	-0,01%	-17,43%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.805,12	-0,99%	-19,62%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.188,16	-0,62%	-14,87%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.358,53	-0,17%	-6,72%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.246,79	0,03%	0,51%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.912,30	-1,20%	-27,61%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	21.710,00	-2,82%	-8,23%	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.