

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

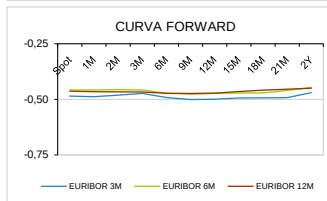
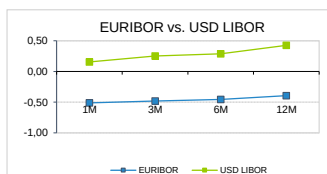
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

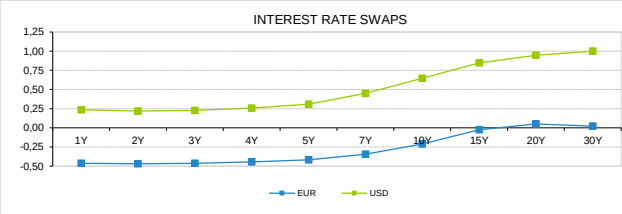
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5120	-1	0	1M	0,1548	0	0	0,0550	-0,7938
3M	-0,4800	0	-1	3M	0,2513	0	0	0,0623	-0,7246
6M	-0,4550	0	-4	6M	0,2878	-2	-2	0,1244	-0,6810
12M	-0,3940	-1	-6	12M	0,4250	-1	-2	0,2261	-0,5428

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4634	-1	-4	-0,4753	-0,3910	-0,2180
2Y	-0,4690	-1	-4	-0,4633	-0,3540	-0,1660
3Y	-0,4625	-1	-4	-0,4382	-0,3135	-0,1131
4Y	-0,4434	-1	-3	-0,4079	-0,2595	-0,0621
5Y	-0,4175	-1	-2	-0,3695	-0,2087	-0,0080
7Y	-0,3443	-1	0	-0,2805	-0,1064	0,0775
10Y	-0,2110	-1	2	-0,1388	0,0207	0,1665
15Y	-0,0250	-2	4	0,0241	0,1236	0,2030
20Y	0,0503	-2	6	0,0753	0,1274	0,1645
30Y	0,0230	-2	8	0,0293	0,0472	0,0575

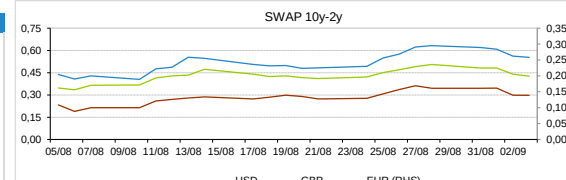
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2354	0	2	0,2054	0,3295	0,7065
2Y	0,2196	0	3	0,2265	0,4333	0,7730
3Y	0,2278	-1	4	0,2585	0,5025	0,8470
4Y	0,2581	-1	4	0,3277	0,5910	0,9438
5Y	0,3096	-1	4	0,4052	0,6710	0,9940
7Y	0,4497	-2	5	0,5599	0,8205	1,0575
10Y	0,6455	-2	9	0,7365	0,9465	1,1145
15Y	0,8459	-2	14	0,8845	1,0490	1,1640
20Y	0,9470	-2	17	0,9865	1,0865	1,1590
30Y	1,0002	-3	19	1,0155	1,0725	1,1127

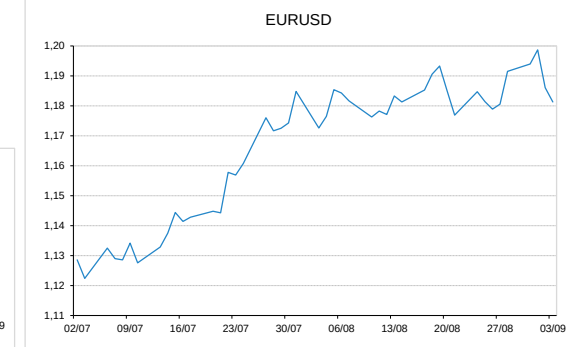
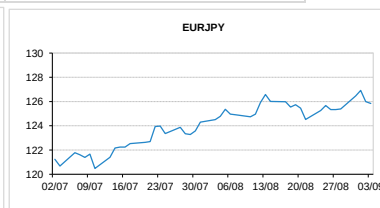
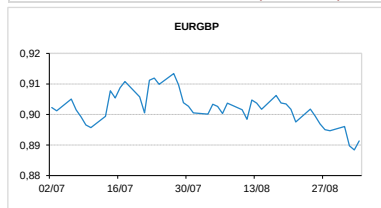


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	43,29	-1,14	-1,24	OT 2Y	-0,543	-0,01	-8,00
JETFUEL	328,46	-12,38	-11,67	OT 5Y	-0,205	-0,01	1,10
DIESEL	357,96	-13,13	-8,42	OT 10Y	0,343	-0,01	4,40
COBRE	6.687,50	9,50	284,00	BUND 10Y	-1,197	-1,80	5,70
ZINCO	2.511,75	-23,00	196,75	SCHATZ 2Y	-0,060	-1,37	0,90
OURO	1.926,36	-9,92	-44,38	T-NOTE 10Y	1,666	-1,96	4,40
TRIGO	551,25	-7,00	22,00	T-NOTE 2Y	0,711	-1,29	2,00
LICENÇA C02	28,80	0,57	2,67	GILT 10Y	0,340	-0,43	15,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1813	-0,40%	0,74%	1,1836	1,1864	1,1912
EUR/GBP	0,89135	-0,33%	0,99%	0,8927	0,8941	0,8972
EUR/JPY	125,85	0,12%	-1,06%	125,85	125,85	125,85
EUR/CHF	1,0774	0,25%	0,24%	1,0767	1,0759	1,0746
EUR/BRL	6,2752	0,97%	-0,20%	6,3045	6,3335	6,4025
EUR/PLN	4,4357	-0,43%	-0,46%	4,4426	4,4518	4,4698



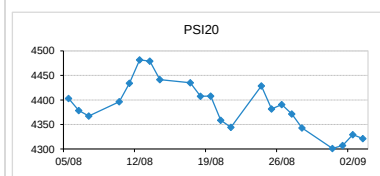
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1813	0,8914	125,85	1,0774	10,3585	7,4397	1,5533	1,62551	6,2752	10,5603
USD	0,8450	-	0,7534	106,225	0,9094	8,7535	6,2868	1,3125	1,3709	5,3068	8,9245

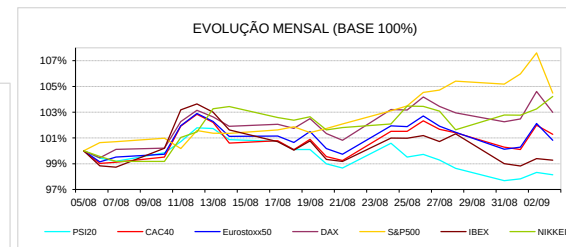
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,360	0,65	-23,24
BCP	0,094	-1,16	-53,85
CORT. AMORIM	10,300	-1,34	-8,85
CTT	2,590	-0,58	-18,81
EDP	4,367	0,18	15,64
EDP R	14,320	-0,69	36,38
GALP	8,860	-0,18	-40,54
IBERSOL	5,420	0,74	-32,25
J MARTINS	13,920	0,65	-5,08
MOTA ENGL	1,506	-2,84	-19,47
NAVIGATOR	2,284	-1,21	-33,77
NOS	3,390	0,24	-29,38
PHAROL	0,111	3,74	11,45
RAMADA	3,410	1,19	-41,61
REN	2,420	-0,62	-11,03
SEMAPA	7,950	0,25	-42,06
SONAE CAP.	0,686	-0,29	-8,90
SONAE SGPS	0,609	1,59	-33,13

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	3,74
SONAE SGPS	1,59
RAMADA	1,19
IBERSOL	0,74
J MARTINS	0,65
EDP R	-0,69
BCP	-1,16
NAVIGATOR	-1,21
CORT. AMORIM	-1,34
MOTA ENGL	-2,84



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.321,03	-0,19%	-17,13%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.996,74	-0,70%	-16,42%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.295,26	-1,27%	-12,01%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.038,61	-1,55%	-1,59%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.476,05	-2,90%	7,62%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.988,20	-0,12%	-26,82%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.465,53	0,94%	-0,81%	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.