

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

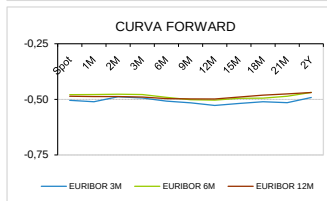
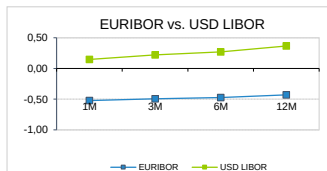
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

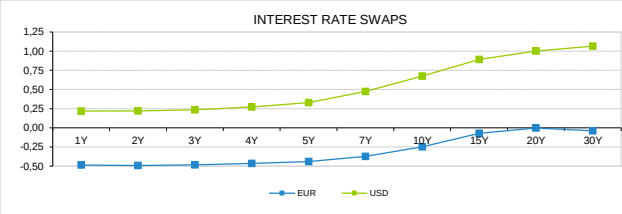
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5230	0	0	1M	0,1466	0	-1	0,0459	-0,8096
3M	-0,4940	0	-2	3M	0,2204	0	-2	0,0615	-0,7604
6M	-0,4740	0	-3	6M	0,2693	0	-4	0,0891	-0,7234
12M	-0,4300	0	-6	12M	0,3655	0	-8	0,1520	-0,5932

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4850	0	-4	-0,5000	-0,4106	-0,2575
2Y	-0,4918	0	-6	-0,4839	-0,3774	-0,2069
3Y	-0,4837	-1	-7	-0,4594	-0,3370	-0,1598
4Y	-0,4653	-1	-7	-0,4307	-0,2918	-0,1109
5Y	-0,4400	-1	-8	-0,3957	-0,2464	-0,0573
7Y	-0,3721	-1	-9	-0,3137	-0,1511	0,0203
10Y	-0,2482	-2	-10	-0,1816	-0,0303	0,1068
15Y	-0,0720	-2	-12	-0,0261	0,0662	0,1388
20Y	-0,0027	-2	-13	0,0197	0,0658	0,0968
30Y	-0,0400	-2	-15	-0,0364	-0,0232	-0,0174

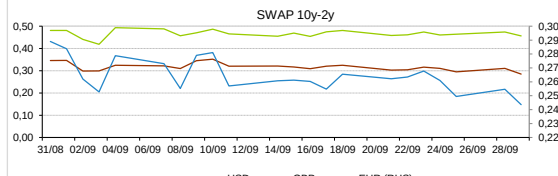
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2185	-1	-1	0,2205	0,3828	0,7440
2Y	0,2197	-1	0	0,2446	0,4730	0,8300
3Y	0,2359	-1	1	0,2889	0,5590	0,9090
4Y	0,2725	-1	1	0,3565	0,6485	0,9777
5Y	0,3300	-1	0	0,4310	0,7300	1,0344
7Y	0,4743	-2	-1	0,5890	0,8570	1,1055
10Y	0,6756	-2	-2	0,7750	0,9950	1,1735
15Y	0,8921	-3	-2	0,9677	1,1095	1,2310
20Y	1,0017	-3	-2	1,0450	1,1520	1,2315
30Y	1,0651	-3	-2	1,0860	1,1480	1,1893

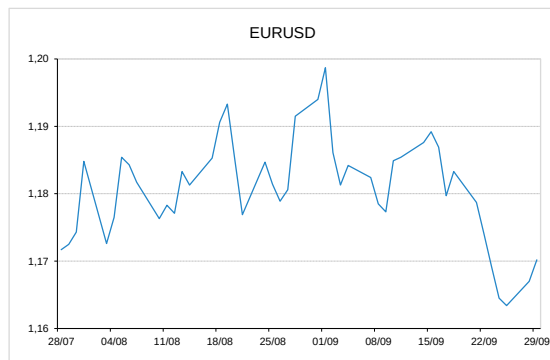
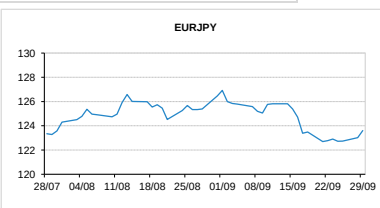
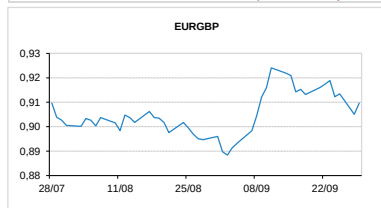


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	40,93	-1,50	-4,88	OT 2Y	-0,580	0,01	-8,70
JETFUEL	323,25	3,02	-14,75	OT 5Y	-0,232	-0,01	-7,30
DIESEL	335,25	6,26	-34,00	OT 10Y	0,236	-0,03	-16,30
COBRE	6.595,00	27,00	-95,00	BUND 10Y	-1,053	-1,21	-13,30
ZINCO	2.422,50	64,75	-85,75	SCHATZ 2Y	-0,137	0,00	-3,60
OURO	1.890,85	16,22	-73,98	T-NOTE 10Y	1,668	-1,12	-5,90
TRIGO	548,75	-1,50	0,00	T-NOTE 2Y	0,717	0,00	0,00
LICENÇA C02	26,82	-0,89	-2,70	GILT 10Y	0,293	-1,53	-12,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1702	0,27%	-1,99%	1,1729	1,1751	1,1799
EUR/GBP	0,90963	-0,50%	-1,49%	0,9110	0,9124	0,9153
EUR/JPY	123,61	-0,48%	2,31%	123,61	123,61	123,61
EUR/CHF	1,0797	-0,19%	-0,13%	1,0788	1,0781	1,0767
EUR/BRL	6,6393	-0,52%	-1,22%	6,6726	6,7094	6,8088
EUR/PLN	4,5275	1,28%	-2,96%	4,5367	4,5445	4,5622



FIXINGS CONTRA USD e EUR

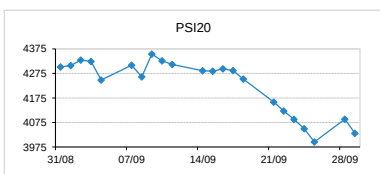
	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1702	0,9096	123,61	1,0797	10,5477	7,4454	1,5711	1,64777	6,6393	11,0840
USD	0,8524	-	0,7786	105,675	0,9216	8,9687	6,3464	1,3407	1,4049	5,6414	9,4293

ACCIONISTA

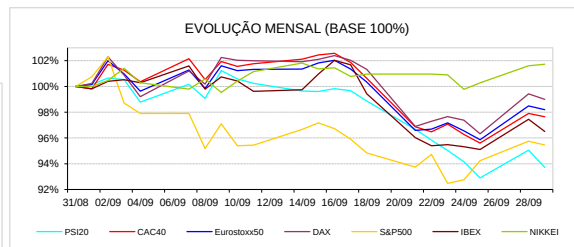
TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,650	-4,20	-35,74
BCP	0,080	-3,27	-60,65
CORT. AMORIM	10,380	-1,14	-8,14
CTT	2,490	-0,40	-21,94
EDP	4,148	-0,53	9,84
EDP R	13,780	-0,29	31,24
GALP	7,766	-4,36	-47,88
IBERSOL	4,900	-2,39	-38,75
J MARTINS	13,910	-0,32	-5,15
MOTA ENIGL	1,044	-3,51	-44,17
NAVIGATOR	2,110	-1,49	-38,81
NOS	3,046	-0,07	-36,54
PHAROL	0,105	-2,78	5,42
RAMADA	3,120	0,00	-46,58
REN	2,365	-0,42	-13,05
SEMAPA	7,540	-0,79	-45,04
SONAE CAP.	0,700	0,00	-7,04
SONAE SGPS	0,571	-3,31	-37,31

MAIORES GANHOS/PERDAS

Título	Variação %
BCP	-3,27
SONAE SGPS	-3,31
MOTA ENIGL	-3,51
ALTRI	-4,20
GALP	-4,36



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.030,97	-1,41%	-22,69%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.830,75	-0,26%	-19,19%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.213,28	-0,31%	-14,20%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.815,06	-0,43%	-3,28%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.340,76	-0,31%	3,42%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.725,40	-0,97%	-29,57%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.539,10	0,12%	-0,50%	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.