

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

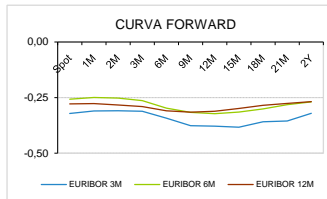
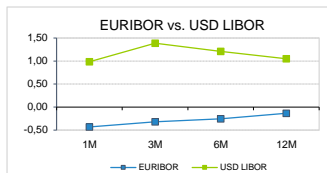
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

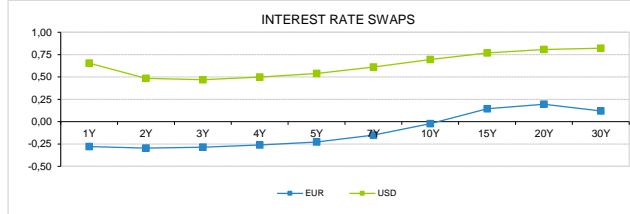
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4310	1	7	1M	0,9851	0	-39	0,2315	-0,7348
3M	-0,3180	2	16	3M	1,3874	1	7	0,6410	-0,6072
6M	-0,2530	2	17	6M	1,2089	0	-4	0,7135	-0,5470
12M	-0,1340	2	21	12M	1,0499	-1	-20	0,8238	-0,4194

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2781	1	18	-0,3198	-0,1904	-0,0103
2Y	-0,2959	1	17	-0,2973	-0,1434	0,0387
3Y	-0,2862	1	18	-0,2606	-0,0989	0,0894
4Y	-0,2612	1	19	-0,2208	-0,0521	0,1320
5Y	-0,2282	1	20	-0,1786	-0,0035	0,1790
7Y	-0,1500	1	22	-0,0872	0,0845	0,2477
10Y	-0,0232	2	23	0,0400	0,1935	0,3210
15Y	0,1447	2	22	0,1809	0,2687	0,3285
20Y	0,1945	3	17	0,2067	0,2458	0,2635
30Y	0,1187	3	10	0,1153	0,1244	0,1227

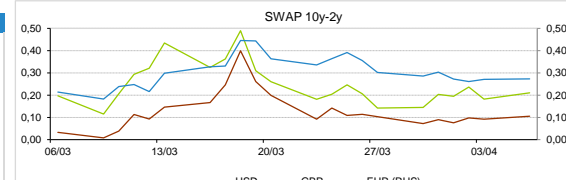
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,75
Austrália	0,25
Índia	3,00



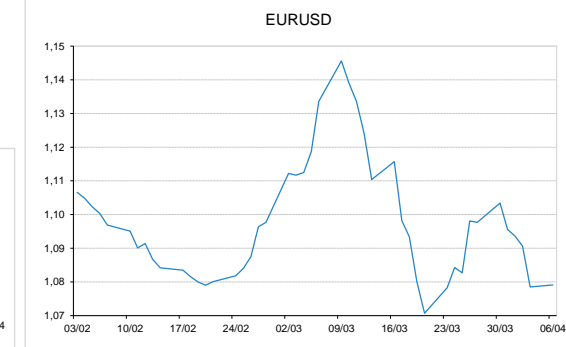
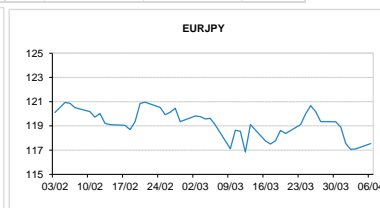
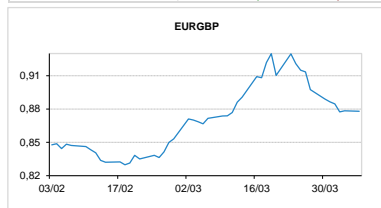
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,6549	1	-3	0,3606	0,5695	0,7600
2Y	0,4847	1	-16	0,3720	0,6390	0,7893
3Y	0,4692	2	-20	0,4265	0,6780	0,7990
4Y	0,4977	3	-20	0,5060	0,7055	0,8260
5Y	0,5395	3	-20	0,5500	0,7330	0,8599
7Y	0,6100	4	-17	0,6275	0,7815	0,8620
10Y	0,6948	4	-15	0,7120	0,8230	0,8780
15Y	0,7689	4	-14	0,7745	0,8547	0,8942
20Y	0,8078	3	-14	0,8117	0,8648	0,8823
30Y	0,8216	3	-14	0,8227	0,8655	0,8799



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	32,88	-1,23	-12,64	OT 2Y	-0,015	0,01	39,90
JETFUEL	251,83	2,09	-226,59	OT 5Y	0,415	-0,01	50,80
DIESEL	304,43	5,78	-159,61	OT 10Y	0,866	-0,03	56,90
COBRE	4.842,00	-57,50	-827,00	BUND 10Y	-0,858	0,89	25,90
ZINCO	1.874,00	-6,25	-90,75	SCHATZ 2Y	-0,044	0,69	18,70
OURO	1.650,30	29,49	-23,53	T-NOTE 10Y	1,774	5,21	-18,50
TRIGO	556,75	7,50	41,00	T-NOTE 2Y	0,880	3,71	-23,20
LICENÇA C02	20,45	2,49	-2,97	GILT 10Y	0,289	1,44	0,70


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0791	0,06%	-4,81%	1,0822	1,0848	1,0903
EUR/GBP	0,878	0,06%	-0,72%	0,8797	0,8814	0,8853
EUR/JPY	117,54	-0,37%	1,31%	117,54	117,54	117,54
EUR/CHF	1,0558	0,04%	0,27%	1,0551	1,0544	1,0529
EUR/BRL	5,6642	2,03%	-7,62%	5,7065	5,7393	5,8003
EUR/PLN	4,5634	0,31%	-5,83%	4,5801	4,5909	4,6085

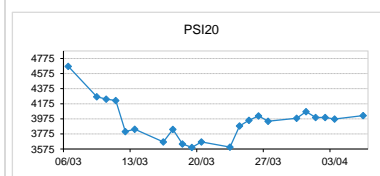

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0791	0,8780	117,54	1,0558	10,9379	7,4675	1,5254	1,77377	5,6642	11,2715
USD	0,9274	-	0,8159	109,135	0,9787	10,1703	6,9238	1,4145	1,6450	5,2379	10,4653

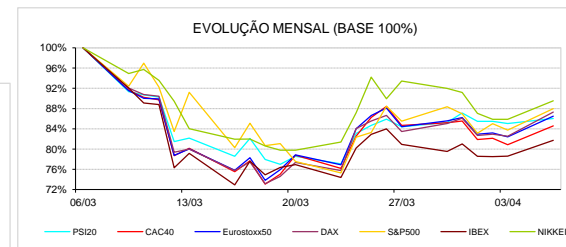
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,970	8,89	-30,11
BCP	0,091	2,58	-54,93
CORT. AMORIM	8,190	1,36	-27,52
CTT	2,225	0,68	-30,25
EDP	3,547	-0,25	-8,20
EDP R	10,460	0,38	-0,38
GALP	9,920	-4,25	-33,42
IBERSOL	4,740	3,04	-40,75
J MARTINS	16,000	-0,62	9,10
MOTA ENGIL	1,212	12,01	-35,19
NAVIGATOR	2,204	3,77	-36,09
NOS	3,138	2,28	-34,63
PHAROL	0,065	2,05	-35,04
RAMADA	2,780	1,09	-52,40
REN	2,390	1,92	-12,13
SEMAPA	8,250	3,77	-39,87
SONAE CAP.	0,455	7,06	-39,58
SONAE SGPS	0,642	6,64	-29,45

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	12,01
ALTRI	8,89
SONAE CAP.	7,06
SONAE SGPS	6,64
SEMAPA	3,77
EDP	-0,25
J MARTINS	-0,62
GALP	-4,25



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.018,62	1,16%	-22,93%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.346,14	4,61%	-27,30%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.795,97	4,99%	-25,34%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	10.075,17	5,77%	-23,96%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.615,32	5,09%	-19,05%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.844,30	3,99%	-28,33%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	18.576,30	4,24%	-21,48%	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.