

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

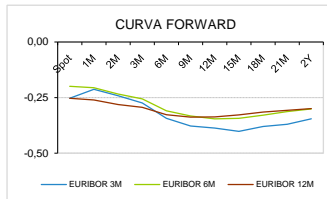
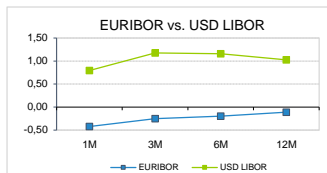
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

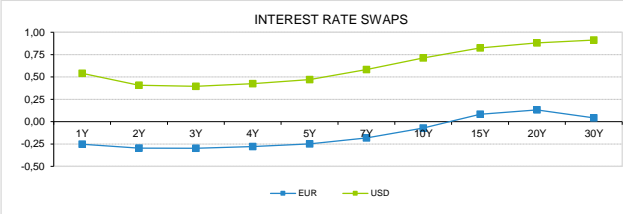
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4220	-2	6	1M	0,7941	-2	-1	0,2438	-0,7326
3M	-0,2500	0	18	3M	1,1761	-4	33	0,6658	-0,5846
6M	-0,1960	0	20	6M	1,1588	-7	34	0,7495	-0,5316
12M	-0,1100	-1	18	12M	1,0259	-3	20	0,8618	-0,4300

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2530	1	14	-0,3399	-0,2294	-0,0648
2Y	-0,2960	0	10	-0,3237	-0,1815	-0,0221
3Y	-0,2977	-1	7	-0,2897	-0,1437	0,0212
4Y	-0,2788	-2	3	-0,2505	-0,1002	0,0640
5Y	-0,2497	-3	0	-0,2132	-0,0594	0,1100
7Y	-0,1826	-4	-1	-0,1337	0,0179	0,1706
10Y	-0,0720	-5	-1	-0,0170	0,1250	0,2461
15Y	0,0822	-6	4	0,1187	0,1976	0,2536
20Y	0,1311	-6	8	0,1410	0,1725	0,1838
30Y	0,0430	-8	15	0,0371	0,0388	0,0309

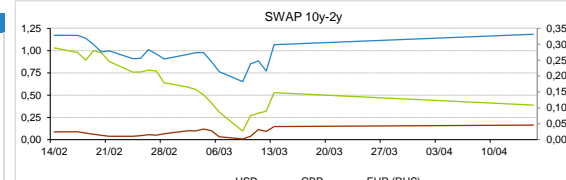
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,75
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,5398	-3	4	0,3277	0,5097	0,7900
2Y	0,4072	-3	-5	0,3165	0,5710	0,8610
3Y	0,3953	-4	-11	0,3735	0,6400	0,9050
4Y	0,4240	-7	-15	0,4598	0,7150	0,9310
5Y	0,4694	-6	-16	0,5308	0,7700	0,9652
7Y	0,5834	-8	-12	0,6325	0,8400	0,9887
10Y	0,7130	-9	-6	0,7550	0,9095	0,9950
15Y	0,8243	-10	3	0,8470	0,9560	1,0160
20Y	0,8807	-10	7	0,9002	0,9630	1,0131
30Y	0,9125	-11	12	0,9157	0,9493	0,9645

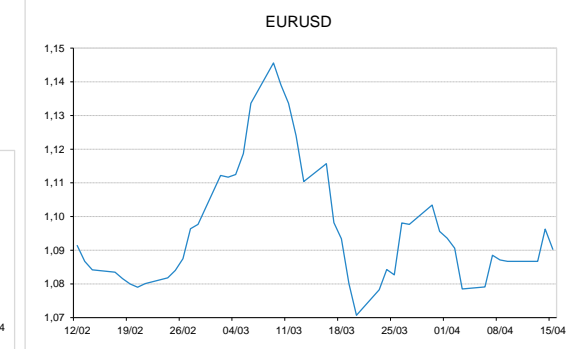
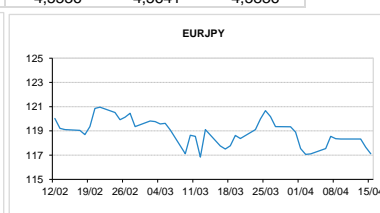
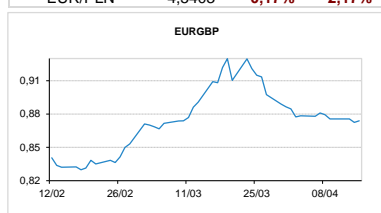


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	27,52	-2,08	-7,92	OT 2Y	0,139	0,08	43,50
JETFUEL	208,64	-25,14	-134,28	OT 5Y	0,553	0,05	-7,50
DIESEL	265,20	-26,55	-80,80	OT 10Y	0,979	0,03	-7,90
COBRE	5.188,50	143,50	-297,00	BUND 10Y	-0,906	-7,49	-12,20
ZINCO	1.915,00	20,75	-67,50	SCHATZ 2Y	-0,087	-2,75	-24,70
OURO	1.712,65	-21,57	182,82	T-NOTE 10Y	1,724	-8,17	-10,40
TRIGO	537,50	-12,25	30,50	T-NOTE 2Y	0,831	-2,41	-101,40
LICENÇA C02	19,19	-0,62	-2,75	GILT 10Y	0,259	-3,31	-30,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0903	-0,55%	-2,28%	1,0928	1,0954	1,1010
EUR/GBP	0,87385	-0,15%	4,04%	0,8754	0,8772	0,8812
EUR/JPY	117,12	0,46%	0,55%	117,12	117,12	117,12
EUR/CHF	1,0525	0,14%	0,41%	1,0518	1,0510	1,0493
EUR/BRL	5,7368	-1,16%	-2,52%	5,7739	5,8042	5,8650
EUR/PLN	4,5403	-0,17%	-2,17%	4,5536	4,5641	4,5836



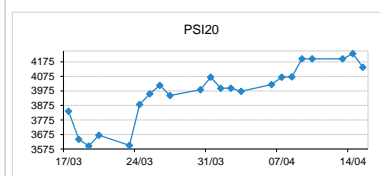
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0903	0,8739	117,12	1,0525	10,9525	7,4617	1,5404	1,72468	5,7368	11,4879
USD	0,9172	-	0,7999	107,415	0,9656	10,0114	6,8438	1,4072	1,5795	5,2546	10,4933

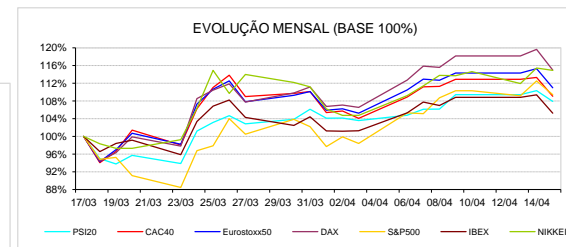
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	4,396	-2,44	-22,61
BCP	0,099	-7,06	-51,28
CORT. AMORIM	8,390	-3,12	-25,75
CTT	2,285	-3,38	-28,37
EDP	3,690	-0,67	-4,50
EDP R	10,500	0,77	0,00
GALP	9,646	-5,06	-35,26
IBERSOL	4,450	-3,05	-44,38
J MARTINS	15,785	0,96	7,64
MOTA ENGIL	1,214	-6,18	-35,08
NAVIGATOR	2,364	-3,35	-31,45
NOS	3,452	0,52	-28,08
PHAROL	0,069	-3,24	-31,02
RAMADA	2,910	-1,36	-50,17
REN	2,440	0,00	-10,29
SEMAPA	8,840	-4,54	-35,57
SONAE CAP.	0,495	-5,53	-34,26
SONAE SGPS	0,651	-5,10	-28,46

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
J MARTINS	0,96
EDP R	0,77
NOS	0,52
GALP	-5,06
SONAE SGPS	-5,10
SONAE CAP.	-5,53
MOTA ENGIL	-6,18
BCP	-7,06



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.137,91	-2,20%	-20,64%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.353,72	-3,76%	-27,17%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.808,20	-3,75%	-25,02%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	10.279,76	-3,90%	-22,41%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.767,15	-2,78%	-14,35%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.839,50	-3,79%	-28,38%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	19.550,09	-0,45%	-17,36%	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.