

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

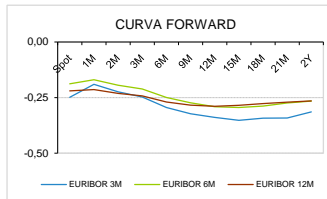
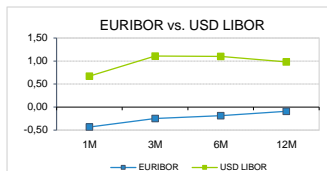
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

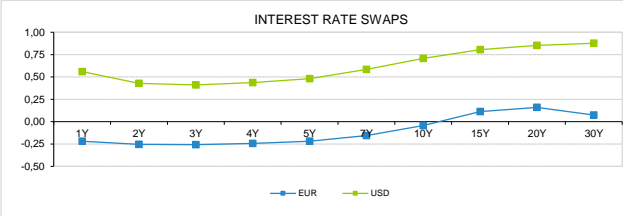
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4330	0	2	1M	0,6728	-5	-8	0,2535	-0,7208
3M	-0,2460	0	13	3M	1,1090	-3	6	0,6598	-0,5858
6M	-0,1850	1	13	6M	1,1025	-2	19	0,7240	-0,5302
12M	-0,0910	1	10	12M	0,9819	0	12	0,8910	-0,4396

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2185	2	10	-0,2950	-0,2048	-0,0426
2Y	-0,2540	3	4	-0,2805	-0,1606	0,0009
3Y	-0,2575	4	0	-0,2542	-0,1242	0,0445
4Y	-0,2441	3	-4	-0,2223	-0,0817	0,0860
5Y	-0,2197	3	-7	-0,1837	-0,0395	0,1300
7Y	-0,1556	4	-11	-0,1074	0,0440	0,1998
10Y	-0,0440	4	-11	0,0108	0,1520	0,2741
15Y	0,1122	4	-7	0,1469	0,2241	0,2822
20Y	0,1592	4	-4	0,1695	0,1992	0,2128
30Y	0,0745	4	-5	0,0665	0,0672	0,0596

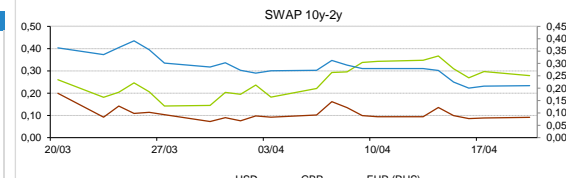
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,75
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,5597	1	-7	0,3416	0,5199	0,7690
2Y	0,4276	1	-8	0,3510	0,5780	0,8220
3Y	0,4108	1	-9	0,4043	0,6390	0,8790
4Y	0,4371	1	-8	0,4681	0,6890	0,9117
5Y	0,4805	0	-7	0,5317	0,7590	0,9409
7Y	0,5847	0	-8	0,6350	0,8260	0,9616
10Y	0,7065	-1	-6	0,7430	0,8790	0,9620
15Y	0,8050	-1	2	0,8310	0,9213	0,9803
20Y	0,8533	-1	6	0,8683	0,9313	0,9724
30Y	0,8770	-2	10	0,8786	0,9126	0,9274

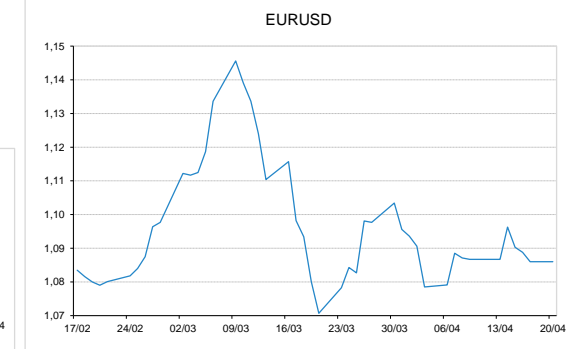
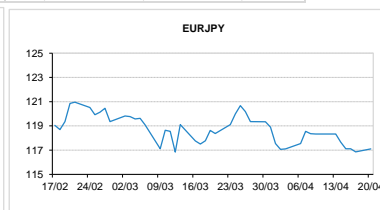
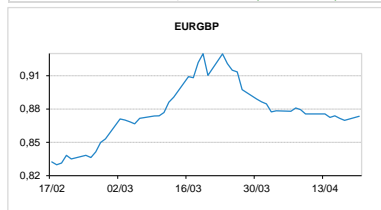


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	26,49	-1,59	-2,51	OT 2Y	0,174	0,03	15,40
JETFUEL	216,41	13,37	-64,86	OT 5Y	0,624	0,07	3,20
DIESEL	270,65	13,62	-35,86	OT 10Y	1,047	0,08	-4,10
COBRE	5.210,00	71,00	67,00	BUND 10Y	-0,880	4,11	-30,10
ZINCO	1.954,00	20,75	87,00	SCHATZ 2Y	-0,057	2,98	-4,10
OURO	1.695,26	12,44	196,61	T-NOTE 10Y	1,736	-0,84	-34,50
TRIGO	555,25	21,50	19,50	T-NOTE 2Y	0,848	0,56	-6,70
LICENÇA C02	21,37	-0,33	5,26	GILT 10Y	0,299	4,33	-50,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,086	0,00%	1,43%	1,0884	1,0910	1,0963
EUR/GBP	0,87343	-0,42%	4,22%	0,8749	0,8766	0,8804
EUR/JPY	117,11	-0,21%	1,08%	117,11	117,11	117,11
EUR/CHF	1,0517	0,03%	0,29%	1,0510	1,0501	1,0481
EUR/BRL	5,7575	-1,14%	-5,97%	5,7832	5,8087	5,8580
EUR/PLN	4,5193	0,01%	0,38%	4,5313	4,5402	4,5582



FIXINGS CONTRA USD e EUR

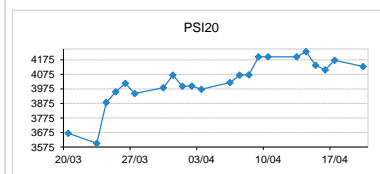
	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0860	0,8734	117,11	1,0517	10,8877	7,4578	1,5297	1,70304	5,7575	11,2719
USD	0,9190	-	0,8015	107,64	0,9664	10,0079	6,8541	1,4052	1,5653	5,2945	10,3709

ACCIONISTA

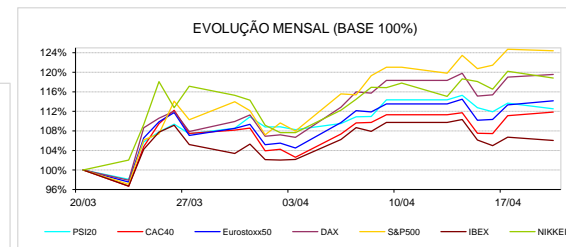
TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,530	-0,48	-20,25
BCP	0,098	-1,02	-51,92
CORT. AMORIM	8,690	-0,46	-23,10
CTT	2,305	-2,54	-27,74
EDP	3,716	-1,62	-3,83
EDP R	10,600	-1,67	0,95
GALP	9,600	-0,27	-35,57
IBERSOL	4,100	-4,21	-48,75
J MARTINS	15,825	-0,31	7,91
MOTA ENGIL	1,174	-1,68	-37,22
NAVIGATOR	2,310	-2,20	-33,01
NOS	3,344	-0,54	-30,33
PHAROL	0,068	-1,16	-31,73
RAMADA	2,850	0,00	-51,20
REN	2,420	-0,62	-11,03
SEMAPA	8,850	-2,53	-35,50
SONAE CAP.	0,489	-1,21	-35,06
SONAE SGPS	0,665	-0,75	-26,98

MAIORES GANHOS/PERDAS

Título	Variação %
MOTA ENGIL	-1,68
NAVIGATOR	-2,20
SEMAPA	-2,53
CTT	-2,54
IBERSOL	-4,21



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.129,50	-1,02%	-20,80%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.528,30	0,65%	-24,25%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.909,50	0,73%	-22,31%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	10.675,90	0,47%	-19,42%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.867,04	-0,26%	-11,26%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.831,50	-0,64%	-28,46%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	19.669,12	-1,15%	-16,86%	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.