

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

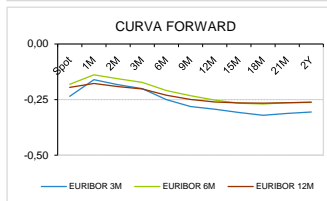
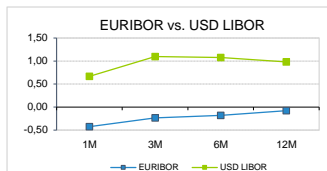
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

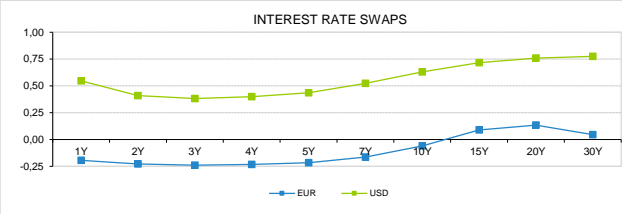
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4250	1	3	1M	0,6674	-1	-26	0,2665	-0,7270
3M	-0,2330	1	14	3M	1,0976	-1	-11	0,6518	-0,5862
6M	-0,1780	1	14	6M	1,0759	-3	8	0,7204	-0,5638
12M	-0,0780	1	11	12M	0,9821	0	5	0,8911	-0,4768

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,1948	3	13	-0,2665	-0,2088	-0,0747
2Y	-0,2280	3	7	-0,2661	-0,1777	-0,0300
3Y	-0,2390	2	3	-0,2463	-0,1436	0,0130
4Y	-0,2325	2	-2	-0,2221	-0,1034	0,0540
5Y	-0,2164	0	-5	-0,1924	-0,0626	0,0940
7Y	-0,1630	-1	-9	-0,1206	0,0162	0,1650
10Y	-0,0592	-1	-9	-0,0087	0,1215	0,2389
15Y	0,0892	-2	-6	0,1215	0,1934	0,2469
20Y	0,1340	-3	-5	0,1416	0,1664	0,1768
30Y	0,0450	-3	-3	0,0360	0,0333	0,0251

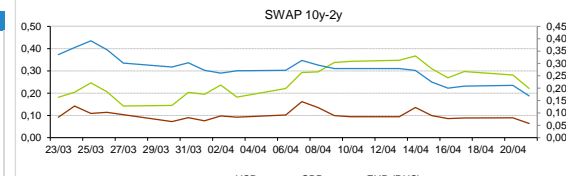
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,75
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,5463	-2	-7	0,3185	0,4447	0,7110
2Y	0,4096	-2	-7	0,3177	0,5172	0,7365
3Y	0,3821	-3	-8	0,3325	0,5777	0,7730
4Y	0,3996	-4	-8	0,3850	0,6055	0,8061
5Y	0,4355	-5	-6	0,4600	0,6550	0,8320
7Y	0,5238	-6	-6	0,5485	0,7376	0,8265
10Y	0,6304	-8	-3	0,6721	0,7800	0,8599
15Y	0,7169	-9	1	0,7384	0,8165	0,8681
20Y	0,7582	-10	4	0,7700	0,8242	0,8490
30Y	0,7751	-10	6	0,7740	0,8003	0,8120

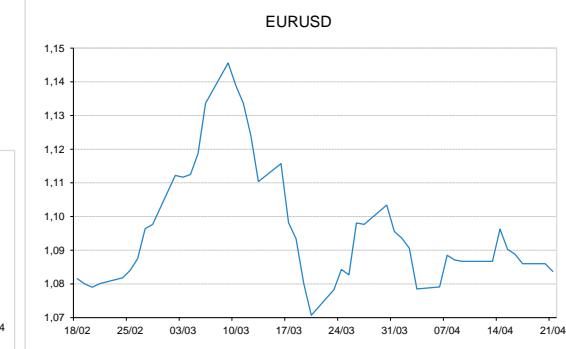
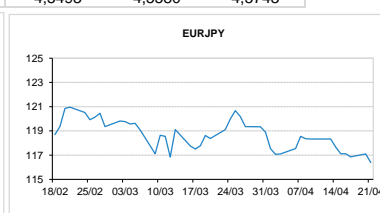
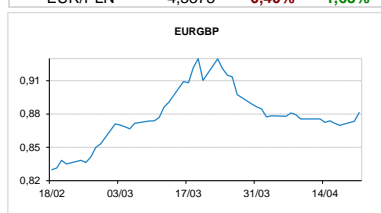


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	19,05	-6,52	-9,95	OT 2Y	0,213	0,04	23,10
JETFUEL	196,75	-19,66	-66,80	OT 5Y	0,724	0,10	25,40
DIESEL	250,25	-20,40	-58,78	OT 10Y	1,159	0,11	21,00
COBRE	5.174,00	-27,50	373,50	BUND 10Y	-0,924	-3,35	-17,10
ZINCO	1.940,50	-13,50	91,50	SCHATZ 2Y	-0,076	-0,69	-3,20
OURO	1.677,38	-17,20	178,73	T-NOTE 10Y	1,683	-4,20	-25,80
TRIGO	545,75	-1,75	10,00	T-NOTE 2Y	0,837	-0,74	-4,50
LICENÇA C02	19,84	-1,54	3,73	GILT 10Y	0,253	-3,57	-26,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0837	-0,21%	0,50%	1,0861	1,0886	1,0937
EUR/GBP	0,8812	-0,88%	5,50%	0,8826	0,8844	0,8880
EUR/JPY	116,39	0,62%	2,34%	116,39	116,39	116,39
EUR/CHF	1,0521	-0,05%	0,41%	1,0514	1,0504	1,0482
EUR/BRL	5,774	-1,42%	-6,24%	5,8179	5,8411	5,8711
EUR/PLN	4,5373	-0,40%	1,63%	4,5493	4,5580	4,5743



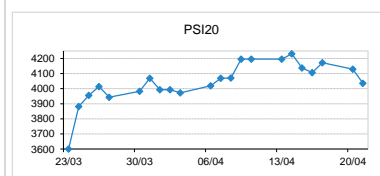
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0837	0,8812	116,39	1,0521	10,9691	7,4564	1,5418	1,72993	5,7740	11,5137
USD	0,9209	-	0,8149	107,65	0,9688	10,1020	6,8681	1,4202	1,5889	5,3143	10,5278

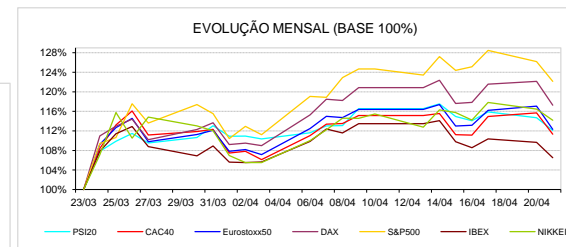
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	4,446	-1,85	-21,73
BCP	0,092	-5,64	-54,64
CORT. AMORIM	8,710	0,23	-22,92
CTT	2,190	-4,99	-31,35
EDP	3,700	-0,43	-4,24
EDP R	10,440	-1,51	-0,57
GALP	9,064	-5,58	-39,17
IBERSOL	3,950	-3,66	-50,63
J MARTINS	15,635	-1,20	6,61
MOTA ENGIL	1,092	-6,98	-41,60
NAVIGATOR	2,266	-1,90	-34,29
NOS	3,278	-1,97	-31,71
PHAROL	0,066	-2,65	-33,53
RAMADA	2,820	-1,05	-51,71
REN	2,400	-0,83	-11,76
SEMAPA	8,630	-2,49	-37,10
SONAE CAP.	0,479	-2,04	-36,39
SONAE SGPS	0,662	-0,38	-27,25

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	0,23
IBERSOL	-3,66
CTT	-4,99
GALP	-5,58
BCP	-5,64
MOTA ENGIL	-6,98



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.035,94	-2,27%	-22,60%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.357,46	-3,77%	-27,11%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.791,34	-4,06%	-25,47%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	10.249,85	-3,99%	-22,64%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.732,51	-3,20%	-15,42%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.634,90	-2,88%	-30,52%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	19.280,78	-1,97%	-18,50%	24.115,95	16.358,19



A informação mencionada é meramente indicativa e reflete 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.