

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

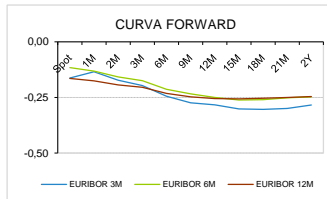
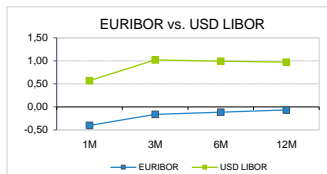
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

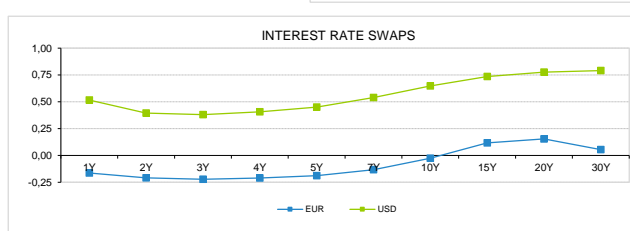
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4020	2	4	1M	0,5698	-5	-36	0,2293	-0,7176
3M	-0,1610	3	21	3M	1,0203	-2	-18	0,6438	-0,5852
6M	-0,1140	1	19	6M	0,9906	-3	0	0,7220	-0,5334
12M	-0,0660	-1	13	12M	0,9704	-2	4	0,8965	-0,4362

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,1640	-1	16	-0,2619	-0,1768	-0,0392
2Y	-0,2095	-2	9	-0,2582	-0,1410	0,0040
3Y	-0,2219	-2	4	-0,2306	-0,1042	0,0485
4Y	-0,2097	-2	1	-0,1995	-0,0659	0,0925
5Y	-0,1880	-3	-2	-0,1648	-0,0253	0,1340
7Y	-0,1323	-3	-6	-0,0912	0,0565	0,2008
10Y	-0,0255	-3	-6	0,0239	0,1554	0,2673
15Y	0,1176	-4	-3	0,1469	0,2166	0,2659
20Y	0,1541	-5	-3	0,1604	0,1826	0,1880
30Y	0,0548	-5	-2	0,0437	0,0400	0,0283

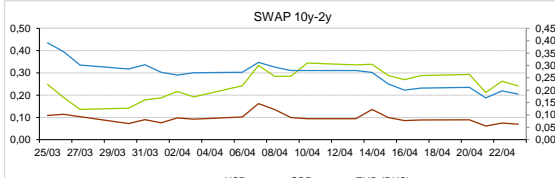
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,75
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,5160	-2	-10	0,3288	0,5023	0,7394
2Y	0,3954	-1	-9	0,3080	0,5490	0,7677
3Y	0,3805	-2	-8	0,3835	0,6000	0,8012
4Y	0,4066	-2	-7	0,4280	0,6619	0,8269
5Y	0,4500	-2	-5	0,4830	0,6940	0,8503
7Y	0,5400	-2	-4	0,5830	0,7520	0,8699
10Y	0,6475	-2	-2	0,6929	0,8089	0,8700
15Y	0,7356	-3	3	0,7653	0,8280	0,8882
20Y	0,7758	-4	6	0,7810	0,8488	0,8800
30Y	0,7909	-4	8	0,7907	0,8224	0,8312

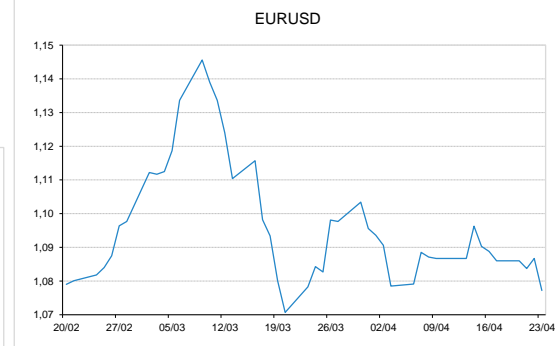
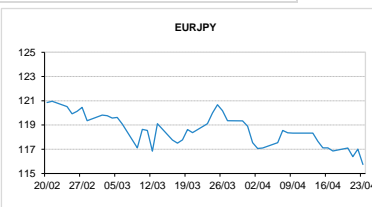
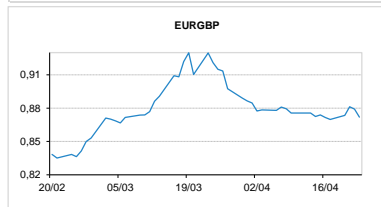


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	22,45	2,08	-6,84	OT 2Y	0,198	-0,05	17,80
JETFUEL	162,67	13,68	-84,64	OT 5Y	0,746	-0,07	18,40
DIESEL	222,06	14,57	-74,64	OT 10Y	1,196	-0,08	12,30
COBRE	5.108,50	101,50	321,50	BUND 10Y	-0,870	-0,69	-12,70
ZINCO	1.886,00	-17,25	37,00	SCHATZ 2Y	-0,066	-1,14	-5,50
OURO	1.730,21	16,32	170,51	T-NOTE 10Y	1,734	0,28	-14,10
TRIGO	544,75	1,00	-11,00	T-NOTE 2Y	0,857	0,74	-3,40
LICENÇA C02	20,95	0,29	5,41	GILT 10Y	0,250	-2,46	-18,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0772	-0,87%	-0,10%	1,0795	1,0819	1,0870
EUR/GBP	0,872	0,83%	6,62%	0,8734	0,8751	0,8788
EUR/JPY	115,75	1,09%	2,90%	115,75	115,75	115,75
EUR/CHF	1,0524	-0,10%	0,37%	1,0517	1,0509	1,0489
EUR/BRL	5,8994	0,06%	-6,58%	5,9143	5,9216	5,9625
EUR/PLN	4,5424	0,33%	1,52%	4,5533	4,5617	4,5777



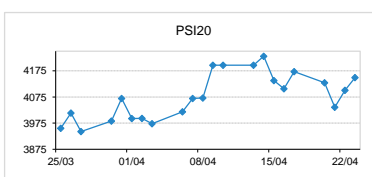
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0772	0,8720	115,75	1,0524	10,8648	7,4576	1,5172	1,69293	5,8994	11,4587
USD	0,9236	-	0,8072	107,605	0,9722	10,0307	6,8880	1,4018	1,5638	5,4705	10,5562

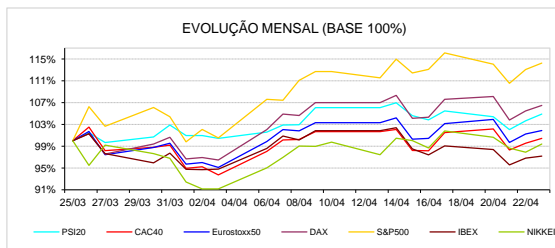
ACCIONISTA

TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,720	2,30	-16,90
BGP	0,096	2,66	-52,47
CORT. AMORIM	8,830	1,61	-21,86
CTT	2,165	0,00	-32,13
EDP	3,789	-0,21	-1,94
EDP R	10,580	0,38	0,76
GALP	9,426	1,68	-36,74
IBERSOL	4,020	1,01	-49,75
J MARTINS	15,900	-0,19	8,42
MOTA ENGIL	1,084	0,18	-42,03
NAVIGATOR	2,346	3,90	-31,97
NOS	3,420	1,54	-28,75
PHAROL	0,069	4,52	-30,42
RAMADA	2,950	5,73	-49,49
REN	2,440	1,46	-10,29
SEMAPA	8,970	2,40	-34,62
SONAE CAP.	0,479	0,42	-36,39
SONAE SGPS	0,684	0,51	-24,89

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
RAMADA	5,73
PHAROL	4,52
NAVIGATOR	3,90
BCP	2,66
SEMAPA	2,40
J MARTINS	-0,19
EDP	-0,21



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.148,91	1,18%	-20,43%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.451,00	0,89%	-25,54%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.852,46	0,62%	-23,84%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	10.513,79	0,95%	-20,64%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.828,47	1,04%	-12,46%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.746,50	0,40%	-29,35%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	19.429,44	1,52%	-17,87%	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.