

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

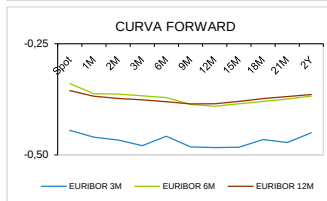
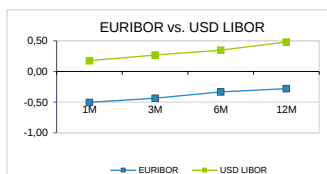
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

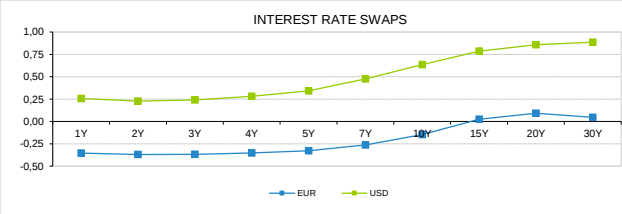
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5030	0	-2	1M	0,1754	0	-2	0,0754	-0,7684
3M	-0,4350	1	-7	3M	0,2681	0	-5	0,0931	-0,6882
6M	-0,3320	0	-13	6M	0,3454	0	-8	0,2229	-0,6376
12M	-0,2800	0	-16	12M	0,4801	0	-17	0,3718	-0,5164

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3550	1	-8	-0,3848	-0,3016	-0,1482
2Y	-0,3699	2	-4	-0,3745	-0,2664	-0,1037
3Y	-0,3680	2	-3	-0,3504	-0,2268	-0,0577
4Y	-0,3515	3	-3	-0,3206	-0,1844	-0,0134
5Y	-0,3271	3	-2	-0,2860	-0,1409	0,0310
7Y	-0,2634	4	-2	-0,2074	-0,0527	0,1132
10Y	-0,1472	4	-2	-0,0836	0,0665	0,2000
15Y	0,0243	5	-1	0,0673	0,1568	0,2322
20Y	0,0915	5	-1	0,1113	0,1534	0,1849
30Y	0,0454	5	-2	0,0518	0,0655	0,0720

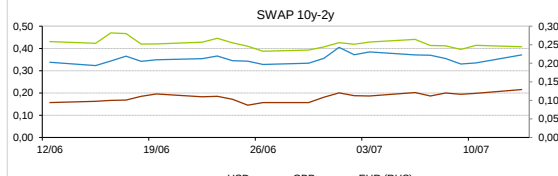
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,25
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2571	1	-4	0,1969	0,4090	0,7565
2Y	0,2273	1	-3	0,2329	0,4999	0,6210
3Y	0,2398	1	-3	0,2890	0,5710	0,7297
4Y	0,2816	1	-3	0,4676	0,6480	0,9041
5Y	0,3429	0	-3	0,4376	0,6950	0,9381
7Y	0,4760	0	-4	0,5560	0,8054	0,9625
10Y	0,6356	0	-5	0,7197	0,8765	0,9980
15Y	0,7852	1	-6	0,8280	0,9310	1,0195
20Y	0,8582	1	-6	0,8860	0,9620	1,0150
30Y	0,8865	1	-7	0,8970	0,9437	0,9639

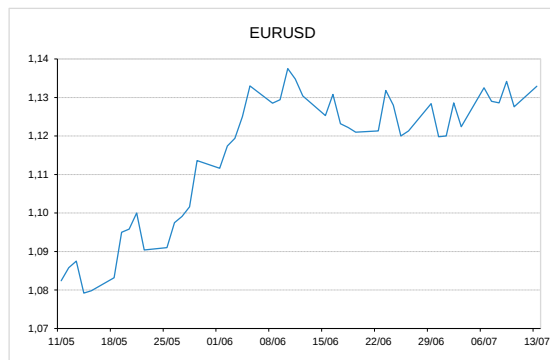
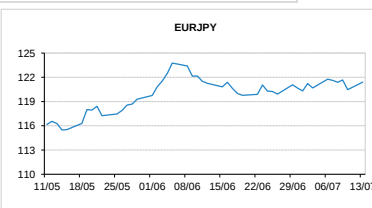
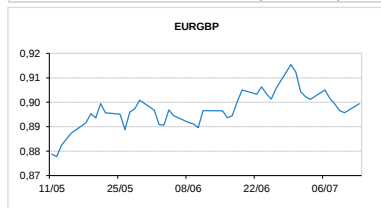


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	43,22	-0,02	4,24	OT 2Y	-0,418	0,02	-7,70
JETFUEL	351,99	-2,01	31,49	OT 5Y	-0,062	0,03	-13,70
DIESEL	372,42	-2,08	40,67	OT 10Y	0,452	0,03	-15,00
COBRE	6.429,00	112,00	505,00	BUND 10Y	-1,105	7,08	-2,20
ZINCO	2.183,75	39,50	170,75	SCHATZ 2Y	-0,011	4,35	1,70
OURO	1.805,48	6,77	74,73	T-NOTE 10Y	1,727	1,12	-0,40
TRIGO	528,50	-5,50	20,75	T-NOTE 2Y	0,759	1,11	-1,30
LICENÇA C02	30,08	1,06	8,08	GILT 10Y	0,220	4,30	-0,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1329	0,47%	0,68%	1,1353	1,1380	1,1424
EUR/GBP	0,89938	-0,41%	-0,32%	0,9007	0,9022	0,9051
EUR/JPY	121,4	-0,76%	-0,47%	121,40	121,40	121,40
EUR/CHF	1,0692	-0,53%	0,12%	1,0685	1,0677	1,0661
EUR/BRL	6,0843	-1,14%	-4,05%	6,1116	6,1419	6,2137
EUR/PLN	4,4860	-0,45%	-1,27%	4,4931	4,5019	4,5190



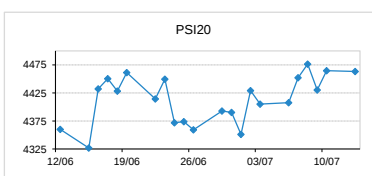
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1329	0,8994	121,40	1,0692	10,3868	7,4447	1,5408	1,62696	6,0843	10,6499
USD	0,8797	-	0,7926	107,275	0,9414	9,1398	6,5497	1,3554	1,4308	5,3436	9,3730

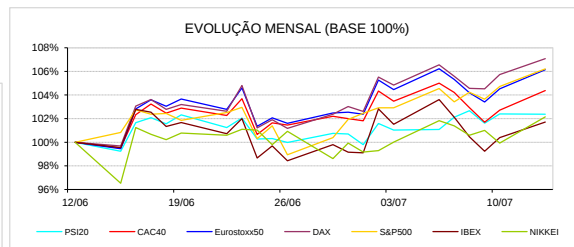
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,280	0,09	-24,65
BCP	0,108	2,95	-46,65
CORT. AMORIM	10,200	0,99	-9,73
CTT	2,180	0,23	-31,66
EDP	4,404	-2,93	13,95
EDP R	13,620	-0,87	29,71
GALP	10,500	0,33	-29,53
IBERSOL	5,800	0,00	-27,50
J MARTINS	15,390	1,06	4,94
MOTA ENGIL	1,212	0,17	-35,19
NAVIGATOR	2,194	1,01	-36,38
NOS	3,536	0,45	-26,33
PHAROL	0,100	-0,20	0,80
RAMADA	3,520	0,00	-39,73
REN	2,490	-0,60	-8,46
SEMAPA	8,290	0,85	-39,58
SONAE CAP.	0,510	-0,78	-32,27
SONAE SGPS	0,653	1,40	-28,24

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	2,95
SONAE SGPS	1,40
J MARTINS	1,06
NAVIGATOR	1,01
CORT. AMORIM	0,99
PHAROL	-0,20
REN	-0,60
SONAE CAP.	-0,78
EDP R	-0,87
EDP	-2,93



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.462,82	-0,03%	-14,40%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.052,38	1,62%	-15,51%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.348,59	1,56%	-10,62%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.795,19	1,28%	-3,43%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.230,34	1,42%	-0,01%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.417,60	1,31%	-22,33%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.784,74	2,22%	-3,69%	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.