

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

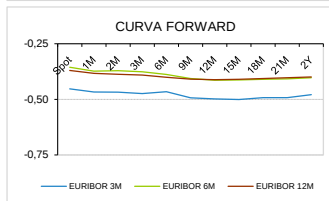
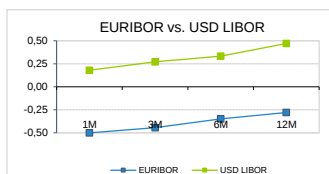
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

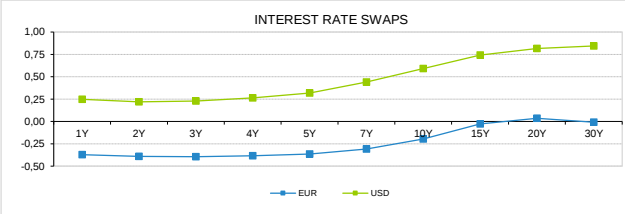
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0.5000	1	1	1M	0.1799	-1	-1	0.0659	-0.7758
3M	-0.4430	0	-4	3M	0.2714	0	-4	0.0776	-0.6934
6M	-0.3480	0	-11	6M	0.3336	-1	-9	0.1874	-0.6498
12M	-0.2790	1	-11	12M	0.4700	-1	-11	0.3293	-0.5210

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3713	0	-4	-0,4125	-0,3540	-0,2130
2Y	-0,3917	0	-2	-0,4067	-0,3220	-0,1655
3Y	-0,3945	0	-1	-0,3894	-0,2851	-0,1208
4Y	-0,3844	-1	-1	-0,3646	-0,2431	-0,0765
5Y	-0,3648	-1	-2	-0,3340	-0,2008	-0,0300
7Y	-0,3078	-1	-3	-0,2594	-0,1135	0,0489
10Y	-0,1965	-2	-3	-0,1380	0,0049	0,1365
15Y	-0,0283	-2	-4	0,0131	0,0992	0,1676
20Y	0,0350	-2	-5	0,0542	0,0936	0,1202
30Y	-0,0090	-3	-6	-0,0071	0,0054	0,0107

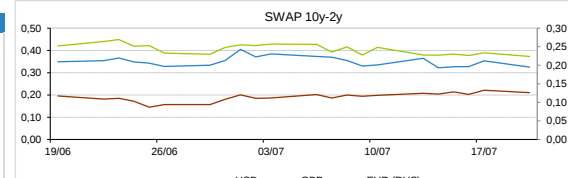
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,25
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2482	-1	-4	0,1877	0,3790	0,6702
2Y	0,2191	-1	-3	0,2127	0,4490	0,7541
3Y	0,2279	-1	-4	0,2690	0,5280	0,8006
4Y	0,2635	-1	-5	0,3325	0,6053	0,8431
5Y	0,3181	-1	-6	0,4016	0,6616	0,8767
7Y	0,4402	-1	-8	0,5332	0,7549	0,9120
10Y	0,5920	-2	-10	0,6630	0,8449	0,9495
15Y	0,7417	-3	-12	0,7965	0,9020	0,9785
20Y	0,8151	-3	-13	0,8430	0,9180	0,9660
30Y	0,8442	-3	-14	0,8629	0,8993	0,9227

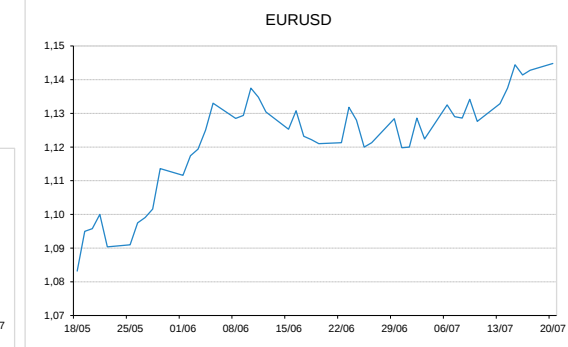
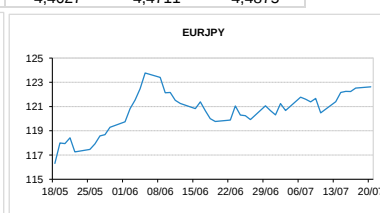


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	43,24	0,10	1,10	OT 2Y	-0,450	-0,03	-5,10
JETFUEL	349,75	-1,00	17,25	OT 5Y	-0,145	-0,06	-11,80
DIESEL	371,25	-1,00	19,75	OT 10Y	0,368	-0,05	-12,60
COBRE	6.437,00	11,50	678,00	BUND 10Y	-1,158	-0,60	-5,10
ZINCO	2.176,25	-43,00	159,25	SCHATZ 2Y	-0,032	-0,23	-0,20
OURO	1.816,41	5,99	72,54	T-NOTE 10Y	1,699	-0,42	-5,20
TRIGO	519,25	-15,50	34,00	T-NOTE 2Y	0,744	0,37	-4,10
LICENÇA C02	26,08	-1,74	1,92	GILT 10Y	0,182	-0,51	-7,50



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1448	0,18%	2,10%	1,1471	1,1498	1,1541
EUR/GBP	0,90575	0,56%	-0,27%	0,9071	0,9085	0,9113
EUR/JPY	122,63	-0,08%	-2,23%	122,63	122,63	122,63
EUR/CHF	1,0745	-0,17%	-0,68%	1,0738	1,0730	1,0714
EUR/BRL	6,1102	0,77%	-3,10%	6,1398	6,1698	6,2432
EUR/PLN	4,4558	0,46%	-0,27%	4,4627	4,4711	4,4875



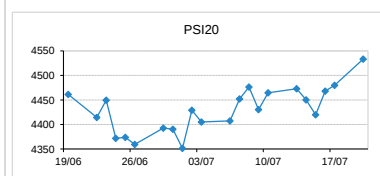
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1448	0,9058	122,63	1,0745	10,2742	7,4454	1,5483	1,63262	6,1102	10,5834
USD	0,8742	-	0,7908	107,18	0,9395	8,9813	6,5093	1,3543	1,4262	5,3524	9,2491

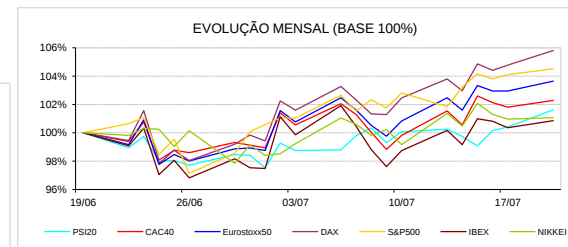
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,442	1,65	-21,80
BCP	0,110	-0,09	-45,81
CORT. AMORIM	9,750	0,52	-13,72
CTT	2,335	2,86	-26,80
EDP	4,642	1,69	20,13
EDP R	14,240	3,19	35,62
GALP	10,335	-0,63	-30,64
IBERSOL	5,680	0,35	-29,00
J MARTINS	14,955	1,08	1,98
MOTA ENGIL	1,230	0,49	-34,22
NAVIGATOR	2,236	2,47	-35,16
NOS	3,670	1,55	-23,54
PHAROL	0,113	12,80	13,25
RAMADA	3,400	3,03	-41,78
REN	2,490	-0,20	-8,46
SEMAPA	8,330	1,22	-39,29
SONAE CAP.	0,500	-0,40	-33,60
SONAE SGPS	0,658	1,15	-27,69

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	12,80
EDP R	3,19
RAMADA	3,03
CTT	2,86
NAVIGATOR	2,47
BCP	-0,09
REN	-0,20
SONAE CAP.	-0,40
GALP	-0,63



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.533,49	1,20%	-13,05%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.093,18	0,47%	-14,80%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.388,34	0,68%	-9,53%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.046,92	0,99%	-1,53%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.237,26	0,41%	0,22%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.478,00	0,51%	-21,69%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.717,48	0,09%	-3,97%	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.