

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

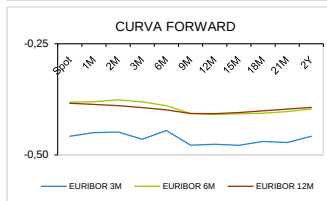
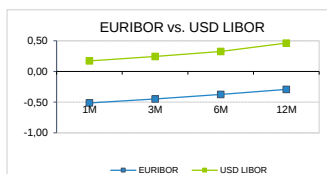
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

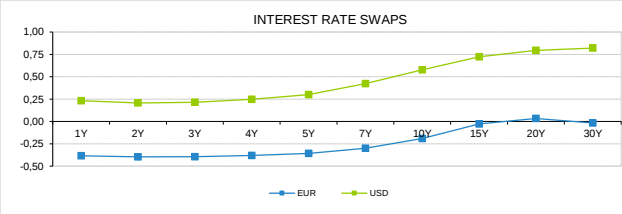
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5130	0	-1	1M	0,1716	-1	-1	0,0675
3M	-0,4480	1	-5	3M	0,2445	-2	-5	0,0810
6M	-0,3730	0	-10	6M	0,3251	0	-6	0,1761
12M	-0,2920	-1	-11	12M	0,4621	0	-10	0,3126

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3840	1	-5	-0,4090	-0,3356	-0,2074
2Y	-0,3958	1	-3	-0,4008	-0,3067	-0,1603
3Y	-0,3940	2	-2	-0,3806	-0,2734	-0,1165
4Y	-0,3798	2	-2	-0,3536	-0,2320	-0,0715
5Y	-0,3578	2	-2	-0,3241	-0,1910	-0,0193
7Y	-0,3003	3	-2	-0,2503	-0,1050	0,0353
10Y	-0,1905	2	-3	-0,1296	0,0095	0,1355
15Y	-0,0275	2	-4	0,0118	0,0929	0,1615
20Y	0,0330	2	-5	0,0493	0,0863	0,1129
30Y	-0,0180	2	-7	-0,0154	-0,0070	-0,0052

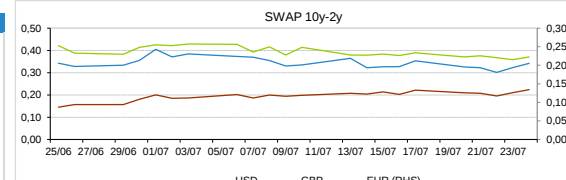
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,25
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2325	0	-5	0,1769	0,3496	0,6560
2Y	0,2068	0	-4	0,1985	0,4210	0,7240
3Y	0,2143	0	-4	0,2502	0,4980	0,7740
4Y	0,2470	-1	-5	0,3149	0,5816	0,8180
5Y	0,2995	-1	-6	0,3864	0,6348	0,8633
7Y	0,4231	0	-8	0,5150	0,7260	0,8950
10Y	0,5776	1	-9	0,6460	0,8090	0,9280
15Y	0,7230	1	-11	0,7630	0,8765	0,9500
20Y	0,7955	2	-12	0,8277	0,8900	0,9420
30Y	0,8203	2	-13	0,8215	0,8400	0,8395

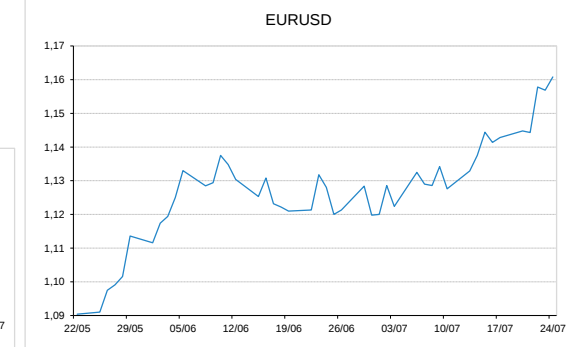
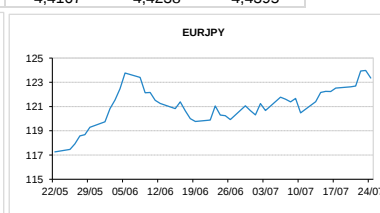


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	43,27	-0,04	2,74	OT 2Y	-0,454	0,01	0,50
JETFUEL	355,25	-8,00	9,50	OT 5Y	-0,154	0,02	-6,00
DIESEL	380,00	-7,25	18,25	OT 10Y	0,354	0,03	-10,40
COBRE	6.506,00	58,50	639,50	BUND 10Y	-1,141	4,13	-0,60
ZINCO	2.238,75	27,50	202,25	SCHATZ 2Y	-0,016	1,60	3,40
OURO	1.903,11	15,67	141,94	T-NOTE 10Y	1,682	0,28	-6,40
TRIGO	542,00	12,50	56,25	T-NOTE 2Y	0,741	-0,37	-3,70
LICENÇA C02	26,62	-0,71	1,22	GILT 10Y	0,180	3,19	-4,50



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1608	0,34%	2,91%	1,1631	1,1658	1,1701
EUR/GBP	0,90985	0,23%	-0,71%	0,9112	0,9127	0,9154
EUR/JPY	123,36	0,50%	-2,48%	123,36	123,36	123,36
EUR/CHF	1,0730	0,02%	-0,60%	1,0723	1,0714	1,0699
EUR/BRL	6,0573	-0,12%	-0,69%	6,0840	6,1126	6,1839
EUR/PLN	4,4108	0,02%	1,04%	4,4167	4,4238	4,4395



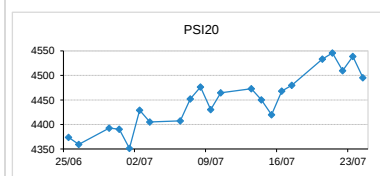
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1608	0,9099	123,36	1,0730	10,2874	7,4426	1,5601	1,63906	6,0573	10,6875
USD	0,8602	-	0,782	105,84	0,9229	8,8461	6,4027	1,3405	1,4085	5,1990	9,1844

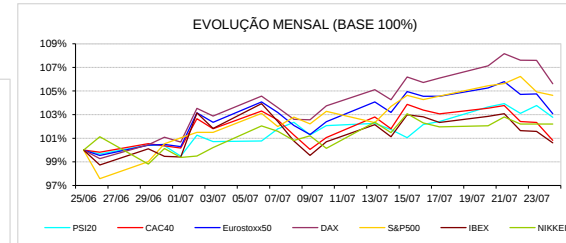
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,318	-1,37	-23,98
BCP	0,104	-1,51	-48,67
CORT. AMORIM	9,650	-0,41	-14,51
CTT	2,260	-1,53	-29,15
EDP	4,466	-1,76	18,26
EDP R	14,020	-3,58	33,52
GALP	10,335	-0,14	-30,64
IBERSOL	5,580	-0,71	-30,25
J MARTINS	14,360	-1,48	-2,08
MOTA ENGIL	1,228	-0,16	-34,33
NAVIGATOR	2,234	-0,09	-35,22
NOS	4,026	1,46	-16,08
PHAROL	0,112	0,18	12,05
RAMADA	3,300	-0,90	-43,49
REN	2,490	-0,40	-8,46
SEMAPA	8,170	0,00	-40,45
SONAE CAP.	0,500	-0,40	-33,60
SONAE SGPS	0,634	0,63	-30,33

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOS	1,46
SONAE SGPS	0,63
PHAROL	0,18
NAVIGATOR	0,09
J MARTINS	-1,48
BCP	-1,51
CTT	-1,53
EDP	-1,76
EDP R	-3,58



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.496,03	-0,96%	-13,79%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.960,40	-1,48%	-17,04%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.318,29	-1,60%	-11,41%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.857,06	-1,84%	-2,92%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.225,95	-0,28%	-0,13%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.317,50	-0,95%	-23,40%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.751,61	-0,58%	-3,83%	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.