

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

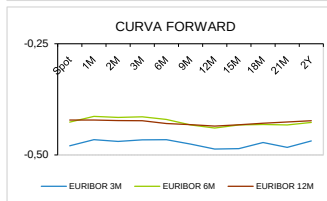
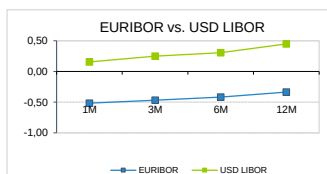
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

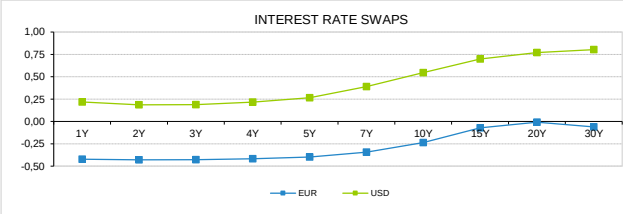
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5160	-1	-1	1M	0,1549	0	-1	0,0586
3M	-0,4690	-1	-3	3M	0,2488	0	-5	0,0844
6M	-0,4170	-1	-10	6M	0,3061	-1	-6	0,1606
12M	-0,3360	0	-10	12M	0,4486	-1	-10	0,3119

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4230	-1	-6	-0,4351	-0,3867	-0,2513
2Y	-0,4294	0	-4	-0,4291	-0,3566	-0,2120
3Y	-0,4270	0	-4	-0,4151	-0,3212	-0,1685
4Y	-0,4170	0	-4	-0,3929	-0,2840	-0,1260
5Y	-0,3988	0	-5	-0,3644	-0,2440	-0,0785
7Y	-0,3439	0	-6	-0,2971	-0,1580	0,0020
10Y	-0,2369	-1	-8	-0,1784	-0,0410	0,0879
15Y	-0,0709	-1	-9	-0,0322	0,0486	0,1170
20Y	-0,0083	-1	-11	0,0081	0,0421	0,0667
30Y	-0,0610	-1	-12	-0,0610	-0,0523	-0,0487

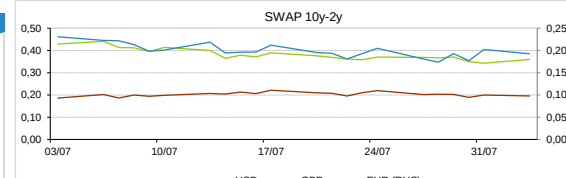
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,25
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2173	1	-5	0,1528	0,3089	0,6372
2Y	0,1858	1	-3	0,1697	0,3829	0,6885
3Y	0,1874	1	-5	0,2041	0,4701	0,7310
4Y	0,2165	1	-5	0,2750	0,5096	0,7880
5Y	0,2657	1	-7	0,3440	0,6000	0,8326
7Y	0,3889	2	-8	0,4782	0,6765	0,8560
10Y	0,5451	2	-10	0,6237	0,7695	0,8830
15Y	0,6980	3	-12	0,7221	0,8375	0,9511
20Y	0,7708	3	-13	0,7800	0,8502	0,8999
30Y	0,8030	3	-13	0,8025	0,8282	0,8636

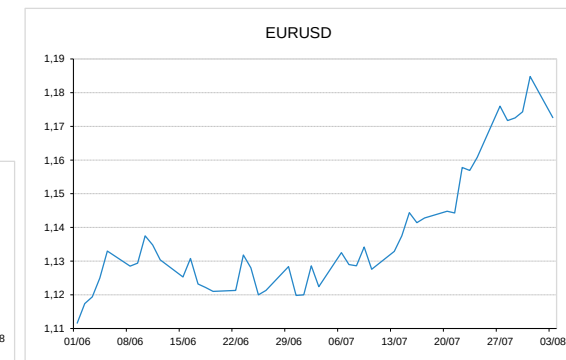
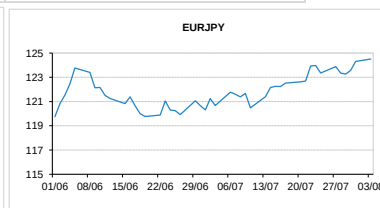
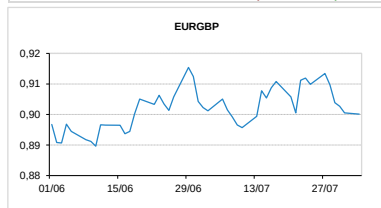


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	44,20	0,68	1,29	OT 2Y	-0,443	0,01	3,40
JETFUEL	340,13	0,38	6,67	OT 5Y	-0,184	0,00	-10,00
DIESEL	366,38	-1,62	9,88	OT 10Y	0,345	-0,01	-9,50
COBRE	6.376,00	-17,50	398,00	BUND 10Y	-1,223	1,19	-8,80
ZINCO	2.311,50	29,00	269,50	SCHATZ 2Y	-0,060	1,83	-1,90
OURO	1.969,67	-6,19	194,69	T-NOTE 10Y	1,648	0,98	-7,90
TRIGO	519,00	-12,25	27,00	T-NOTE 2Y	0,713	0,55	-3,90
LICENÇA C02	25,97	-0,31	-1,94	GILT 10Y	0,126	0,59	-8,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1726	-1,03%	4,47%	1,1748	1,1774	1,1817
EUR/GBP	0,90013	0,04%	0,12%	0,9015	0,9029	0,9056
EUR/JPY	124,51	-0,16%	-3,08%	124,51	124,51	124,51
EUR/CHF	1,0807	-0,45%	-1,65%	1,0800	1,0792	1,0777
EUR/BRL	6,258	-1,73%	-4,49%	6,2859	6,3136	6,3779
EUR/PLN	4,4148	0,00%	1,14%	4,4204	4,4271	4,4425



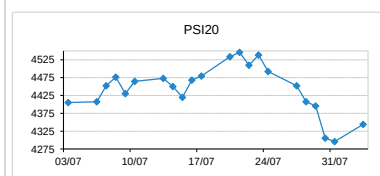
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1726	0,9001	124,51	1,0807	10,2936	7,4458	1,5751	1,65339	6,2580	10,7408
USD	0,8520	-	0,7676	106,095	0,9216	8,7709	6,3445	1,3426	1,4082	5,3309	9,1471

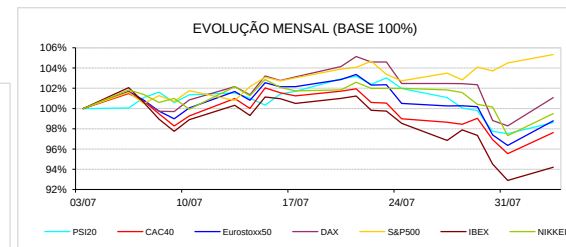
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,300	2,53	-24,30
BCP	0,099	1,12	-51,04
CORT. AMORIM	9,880	0,10	-12,57
CTT	2,350	3,30	-26,33
EDP	4,354	1,61	15,29
EDP R	13,900	0,14	32,38
GALP	9,106	2,31	-38,89
IBERSOL	5,320	-2,56	-33,50
J MARTINS	14,295	0,00	-2,52
MOTA ENGIL	1,200	2,56	-35,83
NAVIGATOR	2,166	2,46	-37,19
NOS	3,766	0,48	-21,54
PHAROL	0,117	-1,52	17,47
RAMADA	3,200	0,63	-45,21
REN	2,455	0,20	-9,74
SEMAPA	7,860	2,75	-42,71
SONAE CAP.	0,654	36,25	-13,15
SONAE SGPS	0,593	-0,25	-34,89

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE CAP.	36,25
CTT	3,30
SEMAPA	2,75
MOTA ENGIL	2,56
ALTRI	2,53
SONAE SGPS	-0,25
PHAROL	-1,52
IBERSOL	-2,56



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.344,09	1,12%	-16,69%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.887,88	2,18%	-18,24%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.254,43	2,52%	-13,10%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.663,96	2,85%	-4,42%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.296,71	0,79%	2,05%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.974,00	1,40%	-26,97%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.195,38	2,24%	-6,18%	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.