

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

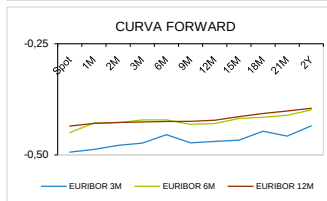
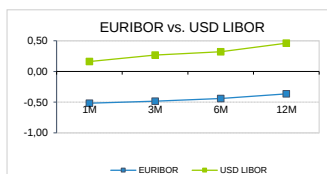
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

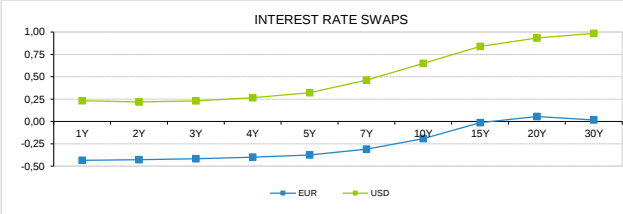
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5170	0	-1	1M	0,1614	1	-2	0,0555	-0,7798
3M	-0,4830	0	-4	3M	0,2678	0	0	0,0734	-0,7106
6M	-0,4400	-1	-9	6M	0,3196	-1	-1	0,1310	-0,6514
12M	-0,3650	-1	-8	12M	0,4604	0	-1	0,2655	-0,5114

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4351	0	-6	-0,4219	-0,3442	-0,1970
2Y	-0,4283	-1	-4	-0,4086	-0,3122	-0,1540
3Y	-0,4178	-1	-2	-0,3875	-0,2859	-0,1090
4Y	-0,3992	-1	-1	-0,3608	-0,2320	-0,0610
5Y	-0,3749	0	-1	-0,3282	-0,1894	-0,0110
7Y	-0,3110	-1	0	-0,2521	-0,0990	0,0700
10Y	-0,1928	-1	0	-0,1240	0,0240	0,1620
15Y	-0,0145	-1	1	0,0332	0,1237	0,1954
20Y	0,0551	-1	2	0,0781	0,1217	0,1516
30Y	0,0161	-1	2	0,0215	0,0346	0,0399

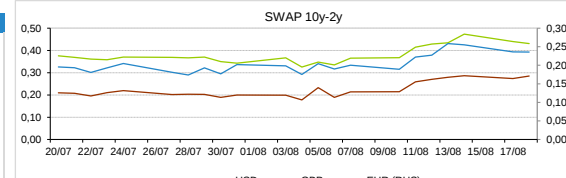
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2310	-1	-2	0,2041	0,3744	0,7356
2Y	0,2180	-1	0	0,2288	0,4600	0,8070
3Y	0,2293	-1	0	0,2759	0,5499	0,8790
4Y	0,2645	-1	0	0,3390	0,6290	0,9290
5Y	0,3209	-1	0	0,4150	0,7060	0,9875
7Y	0,4609	-2	2	0,5710	0,8190	1,0590
10Y	0,6486	-2	5	0,7467	0,9390	1,0950
15Y	0,8387	-2	9	0,8940	1,0310	1,1350
20Y	0,9325	-2	11	0,9660	1,0610	1,1300
30Y	0,9848	-2	14	1,0010	1,0565	1,0895

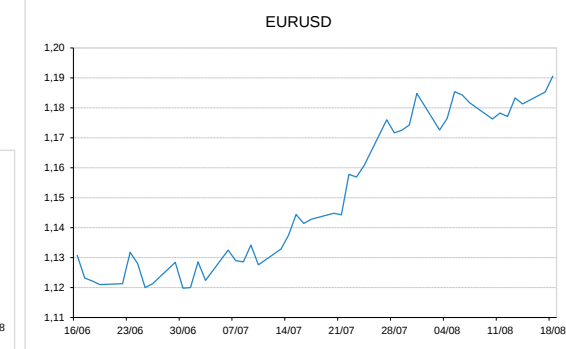
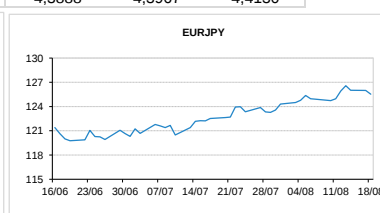


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	45,36	-0,01	2,06	OT 2Y	-0,454	0,00	-3,30
JETFUEL	348,41	-3,07	-1,34	OT 5Y	-0,174	0,00	-8,50
DIESEL	379,50	1,09	8,25	OT 10Y	0,342	-0,01	-7,80
COBRE	6.449,00	79,50	-2,00	BUND 10Y	-1,157	-0,87	-0,50
ZINCO	2.430,25	73,75	251,00	SCHATZ 2Y	-0,014	-0,23	1,60
OURO	2.002,30	14,87	191,88	T-NOTE 10Y	1,700	-0,56	-0,30
TRIGO	515,50	-10,75	-25,00	T-NOTE 2Y	0,748	-0,56	0,70
LICENÇA C02	26,27	-0,03	-1,55	GILT 10Y	0,253	0,42	6,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1906	0,45%	4,00%	1,1929	1,1956	1,2000
EUR/GBP	0,90375	0,28%	0,22%	0,9051	0,9065	0,9093
EUR/JPY	125,54	0,36%	-2,32%	125,54	125,54	125,54
EUR/CHF	1,0773	-0,21%	-0,24%	1,0766	1,0757	1,0745
EUR/BRL	6,539	0,04%	-6,68%	6,5696	6,5964	6,6659
EUR/PLN	4,3827	0,38%	1,69%	4,3888	4,3967	4,4130



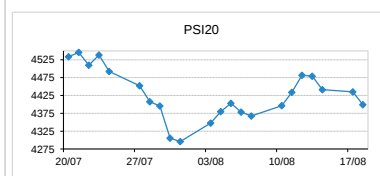
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1906	0,9038	125,54	1,0773	10,3193	7,4458	1,5721	1,6493	6,5390	10,5417
USD	0,8388	-	0,7565	105,455	0,9038	8,6600	6,2454	1,3182	1,3819	5,4776	8,8502

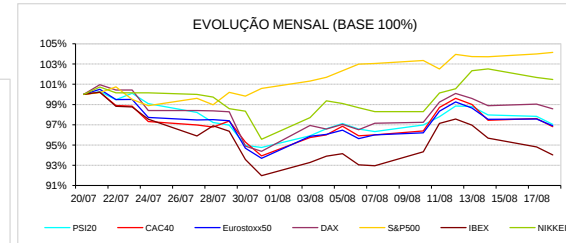
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,418	-1,60	-22,22
BCP	0,104	-1,04	-48,62
CORT. AMORIM	10,460	0,00	-7,43
CTT	2,850	-0,87	-10,66
EDP	4,316	-1,08	14,29
EDP R	13,680	-1,01	30,29
GALP	9,408	-0,42	-36,86
IBERSOL	5,340	1,14	-33,25
J MARTINS	13,975	-0,04	-4,71
MOTA ENGIL	1,432	-3,89	-23,42
NAVIGATOR	2,314	-2,36	-32,90
NOS	3,584	-1,05	-25,33
PHAROL	0,115	-0,86	15,46
RAMADA	3,470	-1,98	-40,58
REN	2,445	0,00	-10,11
SEMAPA	7,940	-1,00	-42,13
SONAE CAP.	0,672	-0,30	-10,76
SONAE SGPS	0,602	-0,66	-33,85

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	1,14
EDP	-1,08
ALTRI	-1,60
RAMADA	-1,98
NAVIGATOR	-2,36
MOTA ENGIL	-3,89



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.399,05	-0,81%	-15,63%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.930,53	-0,83%	-17,52%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.283,29	-0,68%	-12,33%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.859,94	-0,47%	-2,94%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.386,67	0,14%	4,83%	3.395,06	2.191,86
IBEX 35	7.030,30	-0,84%	-26,38%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.051,08	-0,20%	-2,56%	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.