

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

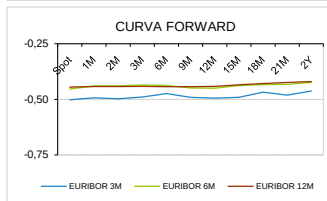
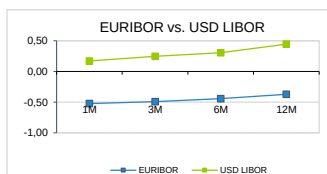
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

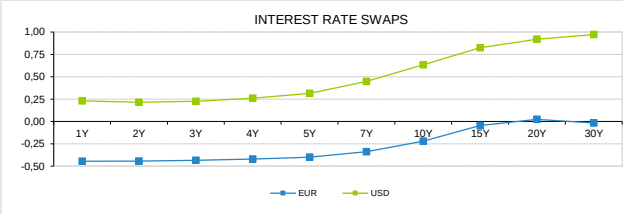
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5230	0	-2	1M	0,1709	1	-1	0,0520	-0,7894
3M	-0,4910	0	-5	3M	0,2469	-1	-2	0,0674	-0,7156
6M	-0,4440	0	-10	6M	0,3045	-1	-3	0,1174	-0,6582
12M	-0,3720	-1	-9	12M	0,4449	0	-3	0,2559	-0,5170

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4451	-1	-7	-0,4415	-0,3781	-0,2274
2Y	-0,4435	-1	-5	-0,4307	-0,3455	-0,1825
3Y	-0,4355	-1	-4	-0,4130	-0,3062	-0,1378
4Y	-0,4205	-1	-4	-0,3879	-0,2640	-0,0914
5Y	-0,3995	-1	-3	-0,3557	-0,2208	-0,0490
7Y	-0,3375	-2	-3	-0,2804	-0,1303	0,0395
10Y	-0,2210	-2	-2	-0,1558	-0,0071	0,1308
15Y	-0,0450	-2	-2	-0,0006	0,0870	0,1641
20Y	0,0231	-2	-1	0,0444	0,0858	0,1190
30Y	-0,0180	-2	-1	-0,0119	-0,0005	0,0053

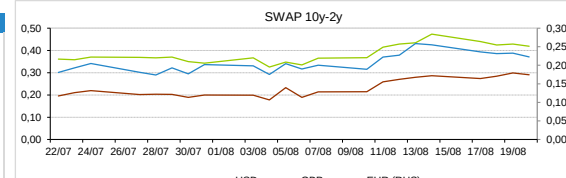
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2306	0	-2	0,2038	0,3580	0,7127
2Y	0,2150	0	0	0,2219	0,4461	0,7690
3Y	0,2255	0	0	0,2695	0,5351	0,8415
4Y	0,2592	0	-1	0,3190	0,5965	0,9178
5Y	0,3135	0	-1	0,4095	0,6918	0,9645
7Y	0,4482	-1	1	0,5500	0,8132	1,0393
10Y	0,6337	-1	4	0,7316	0,9347	1,0961
15Y	0,8239	-1	8	0,8919	1,0085	1,1403
20Y	0,9188	-1	10	0,9656	1,0610	1,1355
30Y	0,9714	-2	12	0,9947	1,0425	1,0747

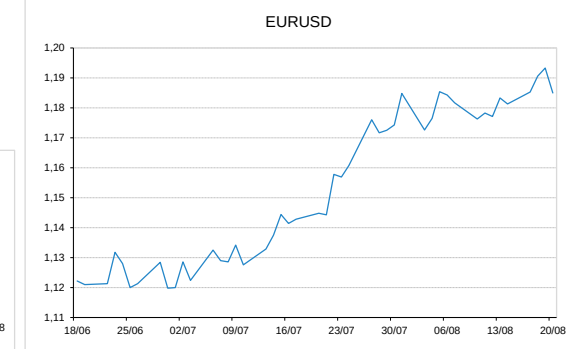
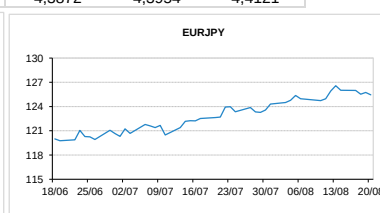


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	44,73	-0,64	1,27	OT 2Y	-0,470	-0,01	-1,50
JETFUEL	347,75	-2,25	-2,00	OT 5Y	-0,197	0,00	-4,90
DIESEL	378,51	-2,99	7,26	OT 10Y	0,324	-0,01	-3,70
COBRE	6.690,00	117,50	237,00	BUND 10Y	-1,195	-2,33	-3,60
ZINCO	2.493,50	46,25	314,25	SCHATZ 2Y	-0,032	-1,15	-0,20
OURO	1.948,24	-15,88	132,09	T-NOTE 10Y	1,686	-1,54	-0,40
TRIGO	522,00	0,00	-6,75	T-NOTE 2Y	0,741	-0,37	0,40
LICENÇA C02	25,85	-0,38	-0,32	GILT 10Y	0,254	-0,51	8,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,185	-0,70%	3,51%	1,1872	1,1898	1,1943
EUR/GBP	0,90173	0,19%	0,45%	0,9031	0,9045	0,9074
EUR/JPY	125,46	0,22%	-2,26%	125,46	125,46	125,46
EUR/CHF	1,0771	0,62%	-0,22%	1,0764	1,0756	1,0743
EUR/BRL	6,6592	-1,23%	-8,37%	6,6886	6,7159	6,7863
EUR/PLN	4,3812	0,51%	1,73%	4,3872	4,3954	4,4121



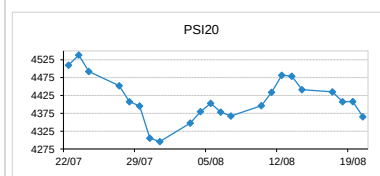
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1850	0,9017	125,46	1,0771	10,3315	7,4453	1,5634	1,65312	6,6592	10,6103
USD	0,8445	-	0,7609	105,945	0,9094	8,7278	6,2875	1,3211	1,3960	5,6496	8,9563

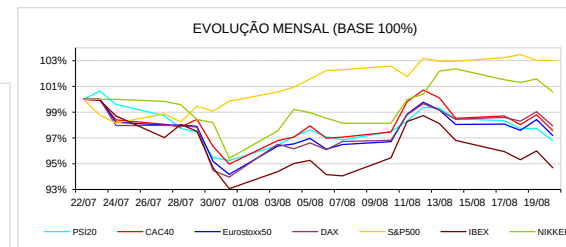
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,286	-3,21	-24,54
BCP	0,103	-1,71	-49,01
CORT. AMORIM	10,260	-1,35	-9,20
CTT	2,760	-2,47	-13,48
EDP	4,270	-0,70	13,07
EDP R	13,940	0,58	32,76
GALP	9,168	-1,69	-38,47
IBERSOL	5,420	0,74	-32,25
J MARTINS	13,855	-0,54	-5,52
MOTA ENGIL	1,390	-3,20	-25,67
NAVIGATOR	2,256	-2,51	-34,58
NOS	3,596	-0,17	-25,08
PHAROL	0,113	0,18	13,05
RAMADA	3,490	-0,29	-40,24
REN	2,450	-0,81	-9,93
SEMAPA	7,780	-1,89	-43,29
SONAE CAP.	0,670	0,00	-11,02
SONAE SGPS	0,601	-0,83	-33,96

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	0,74
EDP R	0,58
PHAROL	0,18
SEMAPA	-1,89
CTT	-2,47
NAVIGATOR	-2,51
MOTA ENGIL	-3,20
ALTRI	-3,21



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.365,06	-0,97%	-16,28%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.915,17	-1,25%	-17,78%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.276,01	-1,25%	-12,53%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.835,05	-1,10%	-3,12%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.375,43	0,01%	4,47%	3.399,54	2.191,86
IBEX 35	6.997,70	-1,36%	-26,72%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.880,62	-1,00%	-3,28%	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.