

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

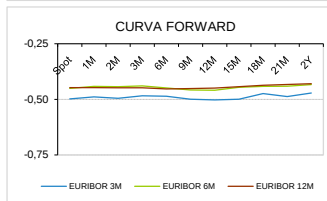
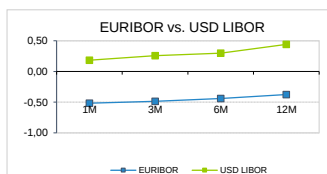
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

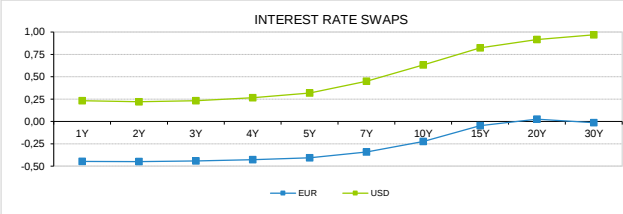
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5170	1	-2	1M	0,1833	1	1	0,0518
3M	-0,4870	0	-4	3M	0,2561	1	0	0,0683
6M	-0,4410	0	-9	6M	0,2986	-1	-4	0,1168
12M	-0,3760	0	-10	12M	0,4406	0	-3	0,2578
								-0,7844
								-0,7158
								-0,6644
								-0,5226

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4475	1	-7	-0,4497	-0,3855	-0,2307
2Y	-0,4494	-1	-5	-0,4397	-0,3520	-0,1848
3Y	-0,4426	-1	-4	-0,4210	-0,3114	-0,1457
4Y	-0,4280	-1	-3	-0,3956	-0,2682	-0,0976
5Y	-0,4061	-1	-3	-0,3624	-0,2282	-0,0484
7Y	-0,3425	-1	-3	-0,2883	-0,1351	0,0370
10Y	-0,2252	-1	-2	-0,1595	-0,0101	0,1287
15Y	-0,0468	0	-1	-0,0009	0,0903	0,1641
20Y	0,0254	0	0	0,0460	0,0893	0,1199
30Y	-0,0137	0	0	-0,0105	0,0018	0,0077

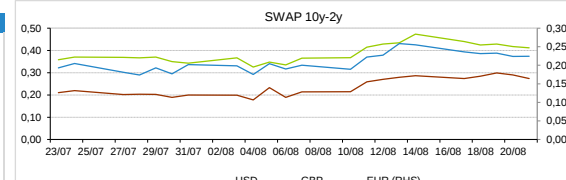
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2315	0	-1	0,2116	0,3679	0,6915
2Y	0,2203	0	1	0,2329	0,4474	0,7862
3Y	0,2321	1	1	0,2756	0,5230	0,8519
4Y	0,2650	0	1	0,3384	0,6155	0,8970
5Y	0,3176	0	1	0,4098	0,6884	0,9565
7Y	0,4498	0	2	0,5568	0,8075	1,0307
10Y	0,6323	0	5	0,7274	0,9286	1,0680
15Y	0,8220	0	9	0,8890	1,0260	1,1344
20Y	0,9160	0	11	0,9624	1,0555	1,1110
30Y	0,9688	0	13	0,9902	1,0185	1,0400

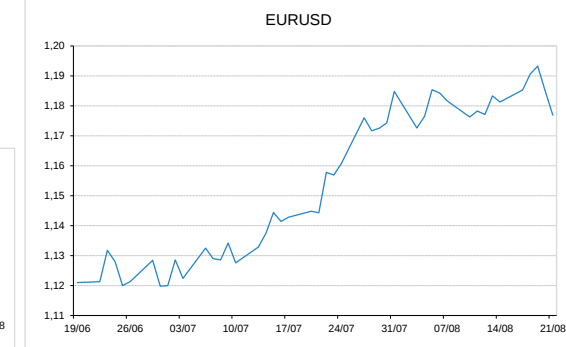
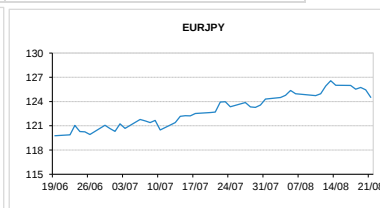
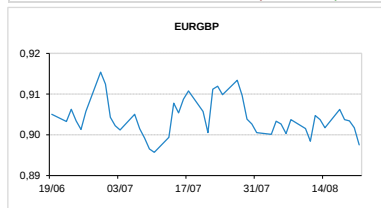


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	43,66	-1,24	-0,89	OT 2Y	-0,471	0,00	0,10
JETFUEL	343,75	-4,00	-10,25	OT 5Y	-0,192	0,00	-2,00
DIESEL	375,50	-3,01	-0,75	OT 10Y	0,330	0,00	-1,60
COBRE	6.613,00	-83,50	114,00	BUND 10Y	-1,210	-1,26	-1,40
ZINCO	2.475,50	-18,00	277,75	SCHATZ 2Y	-0,039	-0,92	1,40
OURO	1.937,20	-7,04	95,39	T-NOTE 10Y	1,679	-0,56	-0,50
TRIGO	528,00	-0,50	-5,75	T-NOTE 2Y	0,743	-0,19	0,00
LICENÇA C02	25,52	-0,38	-1,09	GILT 10Y	0,235	-1,78	9,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1769	-0,68%	2,85%	1,1791	1,1817	1,1863
EUR/GBP	0,89755	0,47%	0,33%	0,8989	0,9003	0,9032
EUR/JPY	124,53	0,75%	-1,47%	124,53	124,53	124,53
EUR/CHF	1,0749	0,23%	-0,05%	1,0741	1,0733	1,0720
EUR/BRL	6,6235	-0,45%	-9,95%	6,6517	6,6791	6,7517
EUR/PLN	4,4095	-0,59%	0,58%	4,4158	4,4243	4,4412



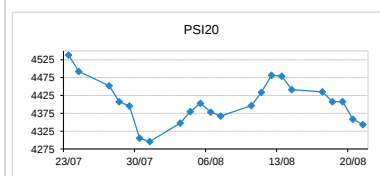
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1769	0,8976	124,53	1,0749	10,3610	7,4458	1,5543	1,64552	6,6235	10,6522
USD	0,8489	-	0,7647	105,965	0,9126	8,7920	6,3209	1,3198	1,3977	5,6119	9,0451

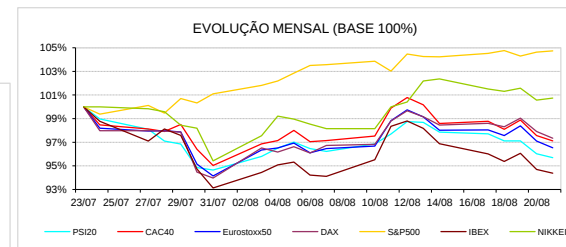
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,222	-1,36	-25,67
BCP	0,102	-0,87	-49,61
CORT. AMORIM	10,040	-1,95	-11,15
CTT	2,815	2,36	-11,76
EDP	4,278	0,19	13,28
EDP R	13,960	0,00	32,95
GALP	8,978	-1,62	-39,74
IBERSOL	5,500	1,48	-31,25
J MARTINS	13,805	-0,32	-5,86
MOTA ENGIL	1,422	2,89	-23,96
NAVIGATOR	2,248	-0,18	-34,81
NOS	3,542	-1,34	-26,21
PHAROL	0,112	-0,53	12,45
RAMADA	3,460	-0,86	-40,75
REN	2,460	0,61	-9,56
SEMAPA	7,780	0,26	-43,29
SONAE CAP.	0,672	0,00	-10,76
SONAE SGPS	0,599	-0,17	-34,23

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	2,89
CTT	2,36
IBERSOL	1,48
REN	0,61
SEMAPA	0,26
BCP	-0,87
NOS	-1,34
ALTRI	-1,36
GALP	-1,62
CORT. AMORIM	-1,95



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.343,44	-0,34%	-16,70%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.888,72	-0,46%	-18,22%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.254,95	-0,58%	-13,09%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.754,18	-0,59%	-3,73%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.389,04	0,10%	4,90%	3.399,54	2.191,86
IBEX 35	6.969,40	-0,34%	-27,02%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.920,30	0,17%	-3,11%	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.