

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

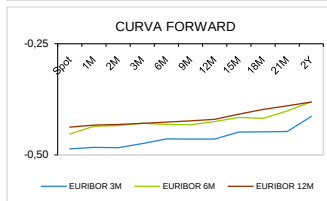
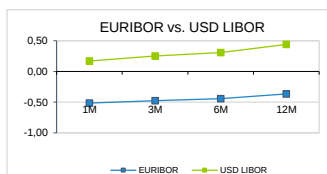
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

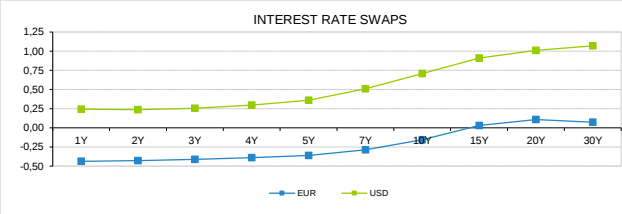
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5150	0	0	1M	0,1703	0	0	0,0546	-0,7822
3M	-0,4760	1	-3	3M	0,2510	2	0	0,0678	-0,7196
6M	-0,4430	0	-7	6M	0,3081	1	-1	0,1150	-0,6682
12M	-0,3660	1	-7	12M	0,4400	0	-2	0,2420	-0,5244

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4371	0	-5	-0,4197	-0,3250	-0,1573
2Y	-0,4275	1	-2	-0,4011	-0,2860	-0,1047
3Y	-0,4122	1	-1	-0,3742	-0,2419	-0,0574
4Y	-0,3898	1	1	-0,3423	-0,1941	-0,0085
5Y	-0,3603	2	2	-0,3050	-0,1481	0,0440
7Y	-0,2860	2	4	-0,2194	-0,0498	0,1308
10Y	-0,1564	2	7	-0,0827	0,0771	0,2216
15Y	0,0310	2	9	0,0809	0,1792	0,2604
20Y	0,1080	3	11	0,1324	0,1815	0,2168
30Y	0,0730	3	13	0,0798	0,0953	0,1039

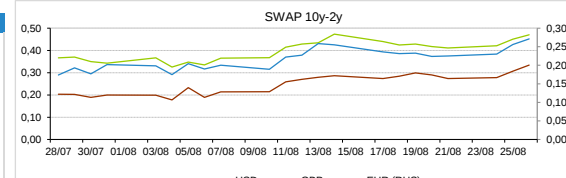
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2432	1	0	0,2317	0,4298	0,7880
2Y	0,2365	1	2	0,2638	0,5075	0,8877
3Y	0,2553	1	3	0,3100	0,6132	0,9230
4Y	0,2974	1	4	0,3891	0,7024	1,0151
5Y	0,3595	2	5	0,4699	0,7797	1,0679
7Y	0,5083	2	7	0,6290	0,9080	1,1310
10Y	0,7069	3	12	0,8030	0,9980	1,1625
15Y	0,9100	4	18	0,9750	1,1342	1,2095
20Y	1,0115	4	21	1,0320	1,1560	1,2050
30Y	1,0696	5	25	1,0977	1,1250	1,1730

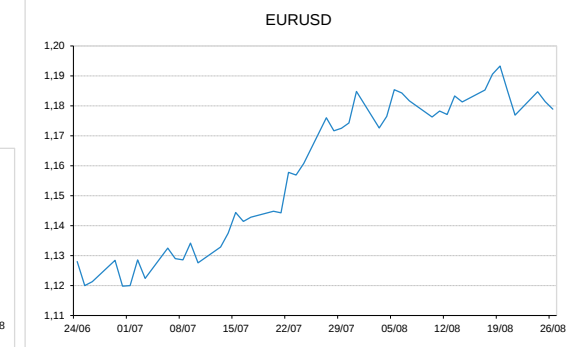
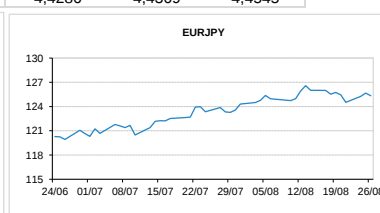
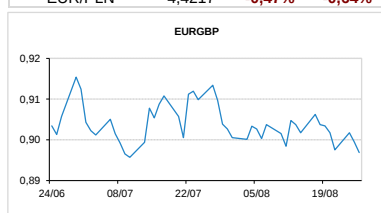


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	45,71	-0,15	1,93	OT 2Y	-0,491	-0,01	-5,00
JETFUEL	349,50	6,75	-5,50	OT 5Y	-0,155	-0,01	-0,30
DIESEL	379,50	6,25	0,00	OT 10Y	0,393	-0,01	4,40
COBRE	6.536,00	13,00	114,00	BUND 10Y	-1,113	1,34	7,40
ZINCO	2.465,50	36,25	249,25	SCHATZ 2Y	-0,002	0,46	3,00
OURO	1.944,07	27,72	42,05	T-NOTE 10Y	1,722	1,54	2,90
TRIGO	537,00	1,50	-8,25	T-NOTE 2Y	0,761	0,93	1,30
LICENÇA C02	28,82	0,21	2,45	GILT 10Y	0,412	3,44	18,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1789	-0,21%	0,25%	1,1812	1,1837	1,1884
EUR/GBP	0,8969	0,28%	1,84%	0,8982	0,8996	0,9026
EUR/JPY	125,34	0,26%	-1,16%	125,34	125,34	125,34
EUR/CHF	1,0736	0,03%	0,72%	1,0729	1,0721	1,0708
EUR/BRL	6,6104	-1,27%	-8,33%	6,6383	6,6642	6,7373
EUR/PLN	4,4217	-0,47%	-0,64%	4,4286	4,4369	4,4545



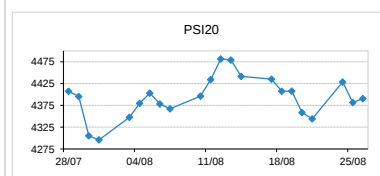
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1789	0,8969	125,34	1,0736	10,3290	7,4437	1,5539	1,6361	6,6104	10,5391
USD	0,8462	-	0,7579	106,145	0,9086	8,7292	6,2987	1,3140	1,3842	5,5598	8,9233

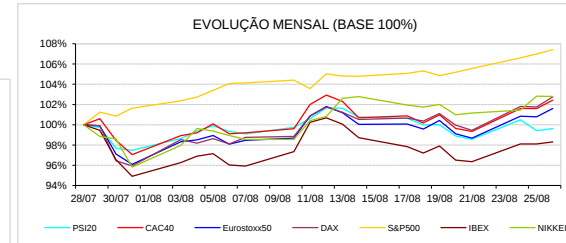
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,228	-0,75	-25,56
BCP	0,102	-0,78	-49,61
CORT. AMORIM	10,060	-0,40	-10,97
CTT	2,710	-1,09	-15,05
EDP	4,359	0,39	15,43
EDP R	14,380	0,98	36,95
GALP	9,210	0,33	-38,19
IBERSOL	5,540	-2,46	-30,75
J MARTINS	14,110	1,07	-3,78
MOTA ENGIL	1,448	2,12	-22,57
NAVIGATOR	2,250	0,00	-34,75
NOS	3,506	-0,74	-26,96
PHAROL	0,110	-0,36	10,04
RAMADA	3,650	1,96	-37,50
REN	2,455	-0,41	-9,74
SEMAPA	7,820	0,26	-43,00
SONAE CAP.	0,682	0,59	-9,43
SONAE SGPS	0,615	2,16	-32,42

TÍTULO	Variação %
SONAE SGPS	2,16
MOTA ENGIL	2,12
RAMADA	1,96
J MARTINS	1,07
EDP R	0,98
NOS	-0,74
ALTRI	-0,75
BCP	-0,78
CTT	-1,09
IBERSOL	-2,46



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.390,62	0,20%	-15,79%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.048,76	0,81%	-15,55%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.356,41	0,80%	-10,38%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.188,56	0,97%	-0,46%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.457,45	0,40%	7,01%	3.457,90	2.191,86
IBEX 35	7.123,50	0,21%	-25,40%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.290,86	-0,03%	-1,55%	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.