

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

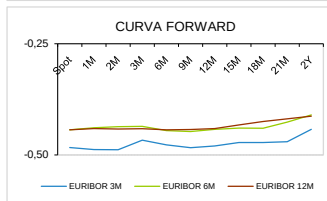
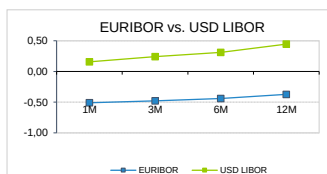
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

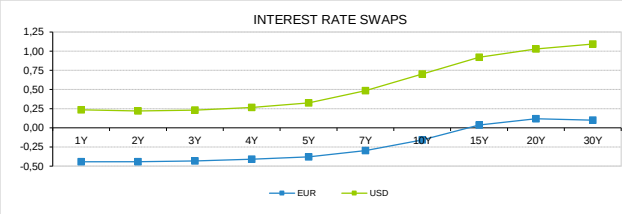
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5100	1	0	1M	0,1568	0	-1	0,0544	-0,7886
3M	-0,4780	0	-2	3M	0,2409	-1	-3	0,0640	-0,7204
6M	-0,4410	1	-3	6M	0,3099	0	-1	0,1163	-0,6680
12M	-0,3730	1	-4	12M	0,4453	0	-2	0,2354	-0,5246

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4429	0	-2	-0,4407	-0,3436	-0,1558
2Y	-0,4420	-1	-1	-0,4269	-0,3032	-0,0996
3Y	-0,4320	-1	-1	-0,3999	-0,2538	-0,0453
4Y	-0,4092	-2	1	-0,3657	-0,2008	0,0080
5Y	-0,3787	-2	2	-0,3236	-0,1481	0,0598
7Y	-0,2977	-2	4	-0,2275	-0,0433	0,1470
10Y	-0,1570	-1	7	-0,0822	0,0907	0,2435
15Y	0,0360	-1	10	0,0893	0,1953	0,2811
20Y	0,1185	-1	12	0,1470	0,2046	0,2502
30Y	0,1005	-1	15	0,1113	0,1340	0,1451

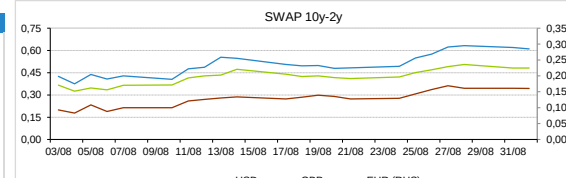
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2358	0	2	0,2020	0,3660	0,7957
2Y	0,2200	0	3	0,2290	0,4669	0,8905
3Y	0,2309	0	4	0,2764	0,5625	0,9687
4Y	0,2666	0	5	0,3438	0,6660	1,0354
5Y	0,3249	0	5	0,4270	0,7565	1,0917
7Y	0,4843	0	9	0,6025	0,9084	1,1520
10Y	0,7018	0	15	0,8099	1,0340	1,2150
15Y	0,9202	0	21	0,9810	1,1415	1,2875
20Y	1,0299	1	25	1,0705	1,1790	1,2650
30Y	1,0932	1	28	1,1105	1,1809	1,2276

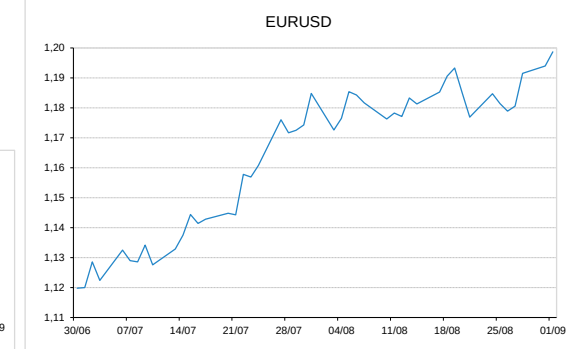
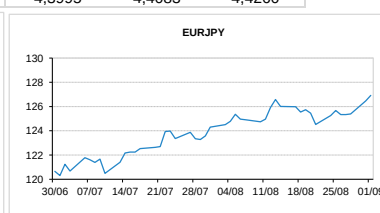


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	45,81	0,53	1,96	OT 2Y	-0,497	-0,01	-4,90
JETFUEL	332,50	-5,50	-7,63	OT 5Y	-0,143	0,00	3,80
DIESEL	363,75	-5,50	-2,63	OT 10Y	0,416	-0,01	6,50
COBRE	6.674,00	46,00	190,00	BUND 10Y	-1,117	-1,21	11,80
ZINCO	2.498,25	30,50	253,50	SCHATZ 2Y	-0,021	-1,38	5,70
OURO	1.973,91	2,02	-1,95	T-NOTE 10Y	1,710	-0,28	6,40
TRIGO	567,75	15,50	29,00	T-NOTE 2Y	0,715	-0,18	2,20
LICENÇA C02	27,77	-0,89	1,49	GILT 10Y	0,409	-1,21	19,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1987	0,39%	2,23%	1,2010	1,2037	1,2083
EUR/GBP	0,88975	0,71%	1,17%	0,8911	0,8925	0,8954
EUR/JPY	126,92	-0,35%	-1,90%	126,92	126,92	126,92
EUR/CHF	1,0842	-0,54%	-0,38%	1,0835	1,0827	1,0813
EUR/BRL	6,4104	2,28%	-2,34%	6,4383	6,4666	6,5368
EUR/PLN	4,3930	0,01%	0,50%	4,3995	4,4083	4,4260



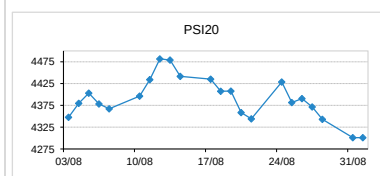
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1987	0,8898	126,92	1,0842	10,3651	7,4439	1,5586	1,62037	6,4104	10,4545
USD	0,8360	-	0,7438	106,005	0,9075	8,6585	6,2229	1,3051	1,3551	5,3628	8,7324

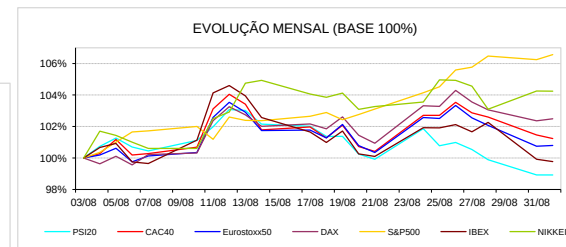
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,246	1,48	-25,25
BCP	0,097	-1,82	-52,22
CORT. AMORIM	10,040	-0,20	-11,15
CTT	2,630	0,96	-17,55
EDP	4,283	0,97	13,41
EDP R	14,200	-0,84	35,24
GALP	8,944	-0,31	-39,97
IBERSOL	5,440	0,74	-32,00
J MARTINS	13,820	0,47	-5,76
MOTA ENGIL	1,582	0,38	-15,40
NAVIGATOR	2,228	1,09	-35,39
NOS	3,370	-0,53	-29,79
PHAROL	0,105	0,38	5,42
RAMADA	3,460	-0,29	-40,75
REN	2,425	-0,21	-10,85
SEMAPA	7,780	2,10	-43,29
SONAE CAP.	0,688	-0,29	-8,63
SONAE SGPS	0,599	0,34	-34,23

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SEMAPA	2,10
ALTRI	1,48
NAVIGATOR	1,09
EDP	0,97
CTT	0,96
SONAE CAP.	-0,29
GALP	-0,31
NOS	-0,53
EDP R	-0,84
BCP	-1,82



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.300,97	0,00%	-17,51%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.936,24	-0,22%	-17,43%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.274,32	0,06%	-12,57%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.961,87	0,13%	-2,17%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.510,95	0,30%	8,67%	3.515,91	2.191,86
IBEX 35	6.958,90	-0,15%	-27,13%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.138,07	-0,01%	-2,19%	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.