

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

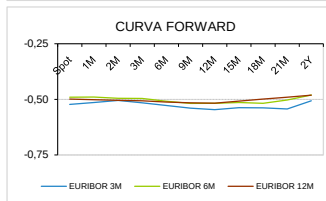
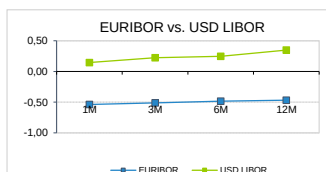
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

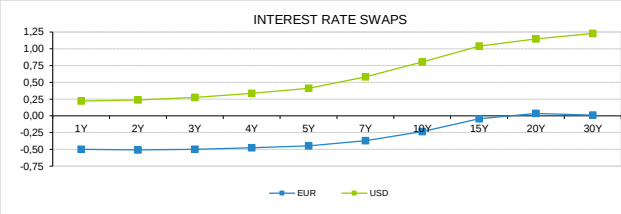
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5380	-1	-2	1M	0,1453	0	-1	0,0455	-0,7964
3M	-0,5110	0	-3	3M	0,2241	0	-3	0,0503	-0,7622
6M	-0,4850	0	-3	6M	0,2458	0	-4	0,0743	-0,7204
12M	-0,4680	-1	-7	12M	0,3476	0	-7	0,1456	-0,6000

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4990	0	-3	-0,5206	-0,4116	-0,2368
2Y	-0,5078	0	-3	-0,4995	-0,3716	-0,1806
3Y	-0,4988	0	-3	-0,4702	-0,3263	-0,1285
4Y	-0,4768	0	-3	-0,4355	-0,2752	-0,0772
5Y	-0,4477	0	-3	-0,3955	-0,2253	-0,0255
7Y	-0,3710	-1	-3	-0,3031	-0,1221	0,0647
10Y	-0,2345	-1	-2	-0,1596	0,0085	0,1561
15Y	-0,0443	-1	-2	0,0067	0,1101	0,1969
20Y	0,0355	-1	-2	0,0624	0,1169	0,1591
30Y	0,0115	-1	-1	0,0216	0,0422	0,0544

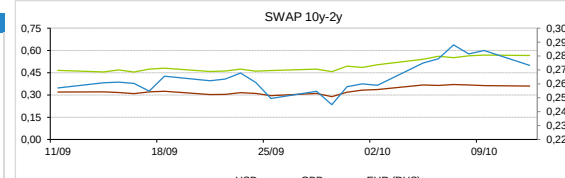
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2204	0	-2	0,2554	0,5225	0,9175
2Y	0,2384	0	2	0,3019	0,6194	1,0194
3Y	0,2751	0	5	0,3747	0,7296	1,0900
4Y	0,3363	0	8	0,4590	0,8186	1,1662
5Y	0,4112	0	9	0,5534	0,8993	1,2141
7Y	0,5820	0	12	0,7254	1,0428	1,3105
10Y	0,8044	0	14	0,9384	1,1891	1,3797
15Y	1,0399	0	16	1,1277	1,2882	1,4136
20Y	1,1481	-1	16	1,2121	1,3430	1,4397
30Y	1,2289	0	18	1,2642	1,3312	1,3750

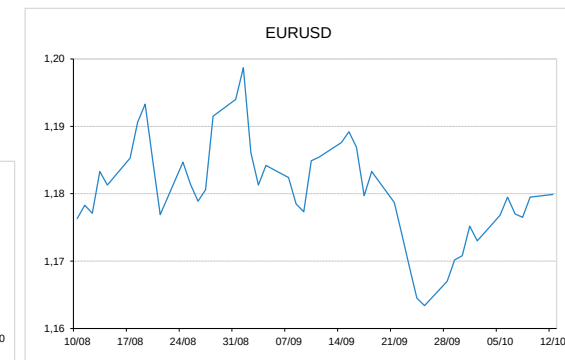
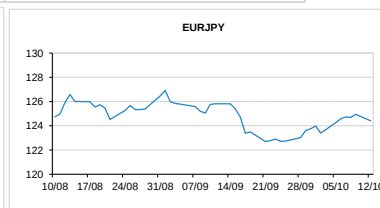
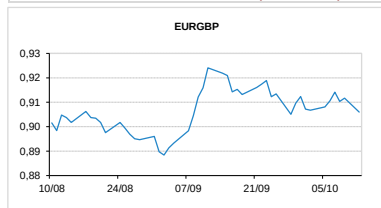


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	41,61	-1,24	1,18	OT 2Y	-0,583	0,01	-3,20
JETFUEL	343,22	-3,46	38,18	OT 5Y	-0,321	-0,02	-14,50
DIESEL	349,64	-1,79	20,59	OT 10Y	0,154	-0,03	-21,60
COBRE	6.772,00	80,00	29,00	BUND 10Y	-1,056	-1,08	-11,70
ZINCO	2.418,00	71,50	10,05	SCHATZ 2Y	-0,151	-0,69	-4,80
OURO	1.922,83	-7,58	-17,72	T-NOTE 10Y	1,749	-0,14	5,30
TRIGO	594,50	0,75	52,50	T-NOTE 2Y	0,746	0,00	1,80
LICENÇA C02	25,75	0,04	-2,51	GILT 10Y	0,378	-0,09	3,20



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1799	0,03%	-0,65%	1,1824	1,1847	1,1896
EUR/GBP	0,90598	0,63%	1,76%	0,9074	0,9088	0,9116
EUR/JPY	124,41	0,43%	1,13%	124,41	124,41	124,41
EUR/CHF	1,0739	0,22%	0,29%	1,0732	1,0725	1,0711
EUR/BRL	6,5448	0,60%	-4,28%	6,5777	6,6091	6,7123
EUR/PLN	4,4786	-0,15%	-0,70%	4,4871	4,4950	4,5125



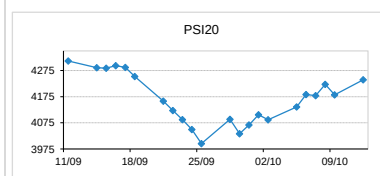
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1799	0,9060	124,41	1,0739	10,3920	7,4427	1,5482	1,6379	6,5448	10,8102
USD	0,8466	-	0,7654	105,285	0,9089	8,7959	6,3011	1,3104	1,3865	5,5315	9,1409

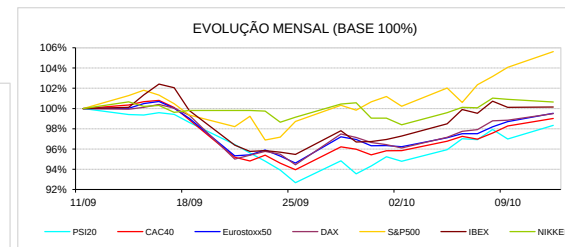
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,792	-1,51	-33,24
BCP	0,080	-2,07	-60,40
CORT. AMORIM	10,640	2,31	-5,84
CTT	2,550	-0,58	-20,06
EDP	4,491	2,72	18,92
EDP R	16,260	7,40	54,86
GALP	8,270	-1,80	-44,50
IBERSOL	4,410	0,92	-44,88
J MARTINS	14,680	1,31	0,10
MOTA ENGIL	1,176	1,73	-37,11
NAVIGATOR	2,098	0,58	-39,16
NOS	3,068	0,33	-36,08
PHAROL	0,102	-1,36	2,01
RAMADA	2,980	-2,61	-48,97
REN	2,420	1,26	-11,03
SEMAPA	7,240	-0,82	-47,23
SONAE CAP.	0,700	0,00	-7,04
SONAE SGPS	0,552	-1,87	-39,40

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP R	7,40
EDP	2,72
CORT. AMORIM	2,31
MOTA ENGIL	1,73
J MARTINS	1,31
ALTRI	-1,51
GALP	-1,80
SONAE SGPS	-1,87
BCP	-2,07
RAMADA	-2,61



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.239,72	1,39%	-18,69%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.984,70	0,77%	-16,62%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.300,11	0,82%	-11,88%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.135,56	0,65%	-0,86%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.529,07	1,49%	9,23%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.953,30	0,03%	-27,18%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.558,69	-0,26%	-0,41%	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.