

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

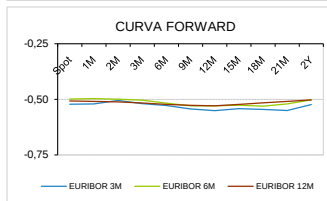
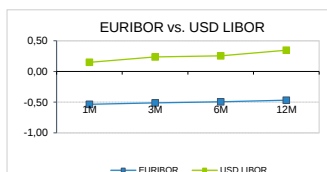
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

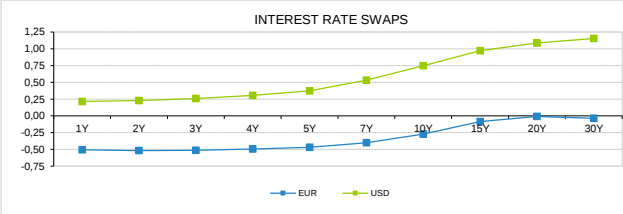
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5350	0	-1	1M	0,1484	0	0	0,0429	-0,7990
3M	-0,5110	0	-3	3M	0,2369	1	-1	0,0464	-0,7682
6M	-0,4930	-1	-3	6M	0,2545	1	-3	0,0809	-0,7266
12M	-0,4680	0	-7	12M	0,3455	0	-7	0,1439	-0,6016

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5075	-1	-4	-0,5300	-0,4455	-0,2818
2Y	-0,5180	-1	-4	-0,5163	-0,4080	-0,2336
3Y	-0,5127	-1	-5	-0,4921	-0,3659	-0,1817
4Y	-0,4953	-1	-5	-0,4610	-0,3201	-0,1310
5Y	-0,4695	-1	-5	-0,4240	-0,2716	-0,0770
7Y	-0,4002	-2	-5	-0,3403	-0,1728	0,0095
10Y	-0,2718	-2	-6	-0,2015	-0,0435	0,1010
15Y	-0,0860	-2	-6	-0,0363	0,0624	0,1407
20Y	-0,0092	-3	-6	0,0159	0,0665	0,1029
30Y	-0,0370	-3	-6	-0,0296	-0,0122	-0,0018

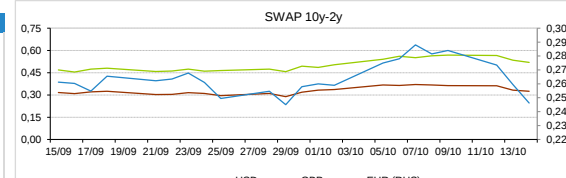
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2144	0	-2	0,2409	0,4490	0,8310
2Y	0,2285	0	1	0,2782	0,5425	0,9190
3Y	0,2573	-1	3	0,3340	0,6445	0,9990
4Y	0,3056	-1	5	0,4139	0,7290	1,0710
5Y	0,3738	-1	6	0,4930	0,8208	1,1340
7Y	0,5310	-1	7	0,6600	0,9618	1,2030
10Y	0,7474	-2	8	0,8565	1,0960	1,2720
15Y	0,9716	-3	9	1,0420	1,2171	1,3469
20Y	1,0861	-3	10	1,1430	1,2460	1,3300
30Y	1,1535	-3	11	1,1849	1,2430	1,2850

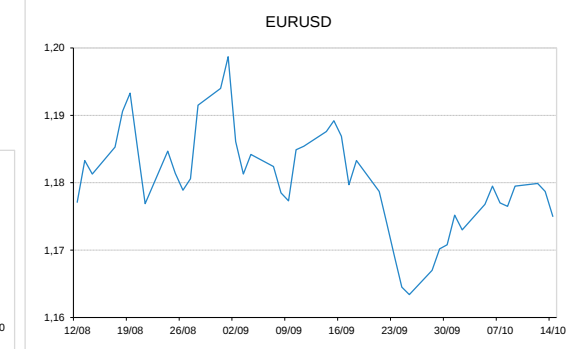
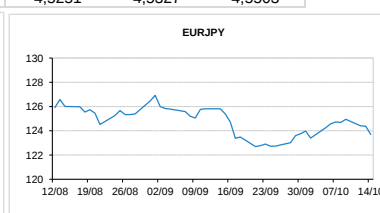


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	43,20	0,75	2,92	OT 2Y	-0,589	-0,01	-2,00
JETFUEL	338,75	5,00	33,75	OT 5Y	-0,342	-0,02	-11,90
DIESEL	341,50	1,25	16,50	OT 10Y	0,133	-0,01	-17,30
COBRE	6.686,00	-45,50	-47,00	BUND 10Y	-1,091	-2,02	-9,20
ZINCO	2.400,00	-23,50	-57,50	SCHATZ 2Y	-0,165	-0,91	-3,00
OURO	1.906,84	15,43	-49,53	T-NOTE 10Y	1,714	-0,28	3,10
TRIGO	591,75	-2,25	46,00	T-NOTE 2Y	0,733	0,18	1,10
LICENÇA C02	25,80	0,58	-4,67	GILT 10Y	0,332	-1,20	3,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,175	-0,31%	-1,06%	1,1776	1,1799	1,1848
EUR/GBP	0,90395	0,22%	1,99%	0,9054	0,9068	0,9097
EUR/JPY	123,7	0,55%	1,71%	123,70	123,70	123,70
EUR/CHF	1,0727	0,10%	0,39%	1,0720	1,0713	1,0701
EUR/BRL	6,5516	-0,12%	-4,52%	6,5830	6,6164	6,7210
EUR/PLN	4,5162	-0,44%	-1,53%	4,5251	4,5327	4,5503



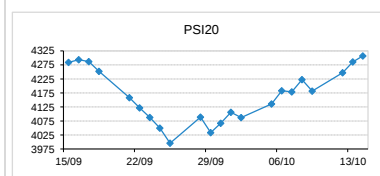
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1750	0,9040	123,70	1,0727	10,3673	7,4427	1,5454	1,63929	6,5516	10,8325
USD	0,8503	-	0,7669	105,105	0,9121	8,8159	6,3290	1,3140	1,3923	5,5623	9,1970

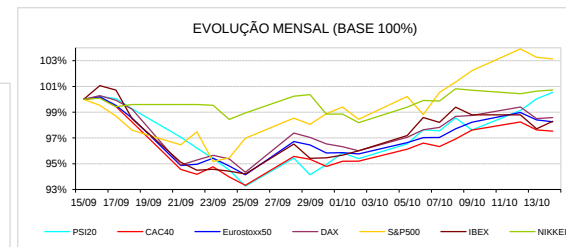
ACCIONISTA

TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,766	-0,11	-33,70
BCP	0,079	-0,76	-61,14
CORT. AMORIM	10,580	-0,56	-6,37
CTT	2,510	0,40	-21,32
EDP	4,696	1,08	24,35
EDP R	17,500	3,92	66,67
GALP	8,310	0,92	-44,23
IBERSOL	4,700	5,86	-41,25
J MARTINS	14,760	-1,34	0,65
MOTA ENGIL	1,136	-1,05	-39,25
NAVIGATOR	2,056	-0,48	-40,38
NOS	3,062	-0,26	-36,21
PHAROL	0,102	-0,20	2,41
RAMADA	3,020	1,68	-48,29
REN	2,440	-0,41	-10,29
SEMAPA	7,190	0,28	-47,59
SONAE CAP.	0,700	0,00	-7,04
SONAE SGPS	0,542	-1,72	-40,44

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	5,86
EDP R	3,92
RAMADA	1,68
EDP	1,08
GALP	0,92
CORT. AMORIM	-0,56
BCP	-0,76
MOTA ENGIL	-1,05
J MARTINS	-1,34
SONAE SGPS	-1,72



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.307,31	0,51%	-17,39%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.942,44	-0,10%	-17,32%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.274,09	-0,16%	-12,58%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.030,90	0,09%	-1,65%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.508,02	-0,11%	8,58%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.916,00	0,59%	-27,58%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.626,73	0,11%	-0,13%	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.