

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

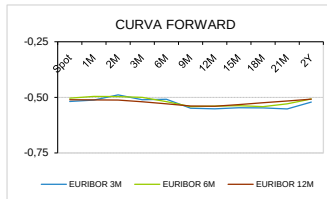
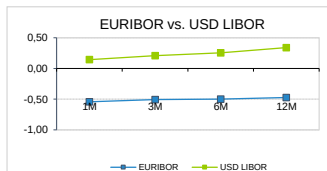
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

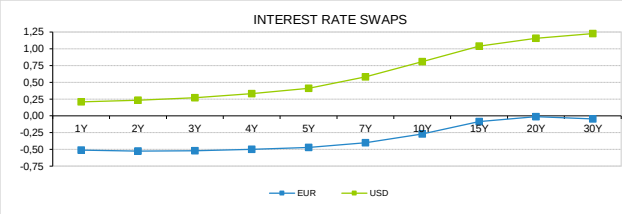
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5430	-1	-2	1M	0,1434	-1	-1	0,0448	-0,7968
3M	-0,5070	0	0	3M	0,2086	-1	-2	0,0476	-0,7624
6M	-0,4980	0	-3	6M	0,2543	0	-2	0,0725	-0,7270
12M	-0,4730	0	-4	12M	0,3398	0	-3	0,1273	-0,6116

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5115	0	-2	-0,5400	-0,4420	-0,2780
2Y	-0,5258	1	-3	-0,5241	-0,4020	-0,2280
3Y	-0,5206	1	-3	-0,4980	-0,3600	-0,1780
4Y	-0,5002	1	-3	-0,4640	-0,3140	-0,1260
5Y	-0,4722	2	-3	-0,4260	-0,2670	-0,0730
7Y	-0,4007	2	-3	-0,3400	-0,1660	0,0130
10Y	-0,2695	3	-3	-0,2000	-0,0420	0,1020
15Y	-0,0857	3	-3	-0,0370	0,0608	0,1370
20Y	-0,0122	3	-3	0,0123	0,0624	0,0960
30Y	-0,0450	3	-3	-0,0387	-0,0225	-0,0150

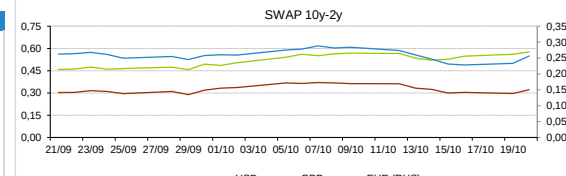
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2085	0	-2	0,2507	0,5130	0,9285
2Y	0,2319	0	2	0,2969	0,6267	1,0005
3Y	0,2705	0	4	0,3708	0,7284	1,0820
4Y	0,3311	1	7	0,4622	0,8035	1,1641
5Y	0,4114	1	8	0,5559	0,8925	1,2216
7Y	0,5816	1	11	0,7205	1,0488	1,3072
10Y	0,8081	2	13	0,9364	1,1904	1,3570
15Y	1,0388	2	15	1,1307	1,3023	1,4090
20Y	1,1562	3	16	1,2219	1,3080	1,4346
30Y	1,2267	3	17	1,2628	1,3271	1,3587

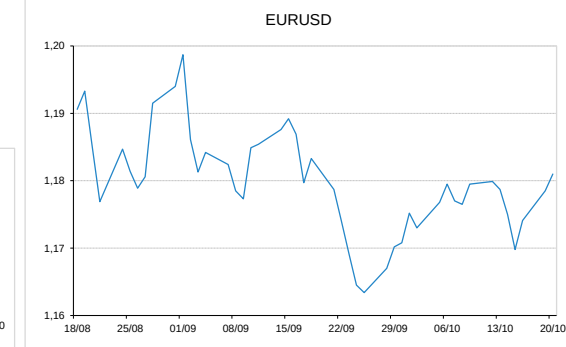
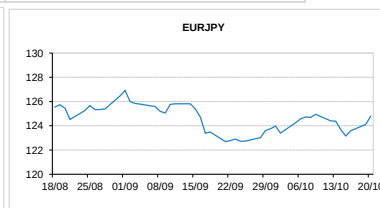
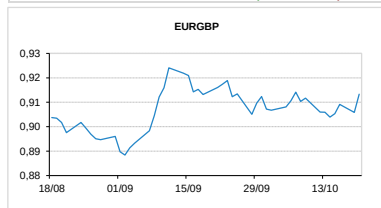


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	42,48	-0,14	-1,20	OT 2Y	-0,578	0,02	0,10
JETFUEL	336,01	-6,16	9,02	OT 5Y	-0,322	0,02	-8,80
DIESEL	339,25	-6,83	0,75	OT 10Y	0,163	0,02	-13,80
COBRE	6.768,00	39,50	-33,00	BUND 10Y	-1,122	1,94	-11,80
ZINCO	2.480,25	54,25	-52,00	SCHATZ 2Y	-0,204	0,23	-7,10
OURO	1.911,59	1,84	-39,27	T-NOTE 10Y	1,751	0,84	5,20
TRIGO	629,00	2,00	54,00	T-NOTE 2Y	0,735	-0,37	0,90
LICENÇA C02	24,55	-0,43	-3,44	GILT 10Y	0,296	1,70	1,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,181	0,21%	0,20%	1,1835	1,1859	1,1908
EUR/GBP	0,91329	-0,81%	0,31%	0,9147	0,9161	0,9190
EUR/JPY	124,79	-0,54%	-1,67%	124,79	124,79	124,79
EUR/CHF	1,0727	-0,11%	0,27%	1,0720	1,0713	1,0700
EUR/BRL	6,5891	0,15%	-3,28%	6,6291	6,6643	6,7762
EUR/PLN	4,5676	0,18%	-1,50%	4,5768	4,5851	4,6019



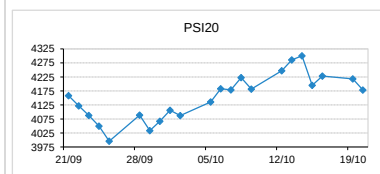
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1810	0,9133	124,79	1,0727	10,3431	7,4429	1,5510	1,67579	6,5891	10,9548
USD	0,8451	-	0,7714	105,575	0,9066	8,7503	6,2896	1,3130	1,4177	5,5750	9,2577

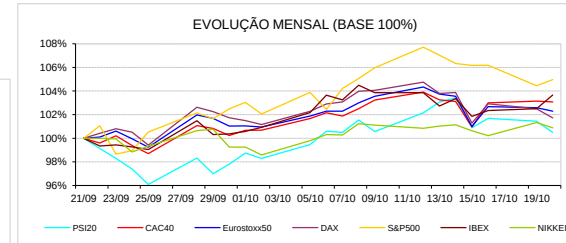
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,644	-2,77	-35,85
BCP	0,077	-0,51	-61,83
CORT. AMORIM	10,300	-1,53	-8,85
CTT	2,405	-2,83	-24,61
EDP	4,451	-1,33	17,86
EDP R	16,780	0,24	59,81
GALP	8,096	-1,03	-45,66
IBERSOL	4,020	1,26	-49,75
J MARTINS	14,665	0,55	0,00
MOTA ENGIL	1,122	1,63	-40,00
NAVIGATOR	2,010	-2,62	-41,71
NOS	3,042	-0,85	-36,63
PHAROL	0,096	-2,45	-4,12
RAMADA	3,000	-0,99	-48,63
REN	2,390	-0,83	-12,13
SEMAPA	7,020	-1,82	-48,83
SONAE CAP.	0,700	0,00	-7,04
SONAE SGPS	0,517	-1,62	-43,24

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
MOTA ENGIL	1,63
IBERSOL	1,26
J MARTINS	0,55
EDP R	0,24
SEMAPA	-1,82
PHAROL	-2,45
NAVIGATOR	-2,62
ALTRI	-2,77
CTT	-2,83



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.178,28	-0,95%	-19,87%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.939,55	0,21%	-17,37%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.233,53	-0,28%	-13,66%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.759,18	-0,74%	-3,70%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.443,45	0,49%	6,59%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.937,60	1,13%	-27,35%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.567,04	-0,44%	-0,38%	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.