

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

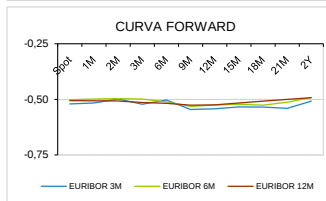
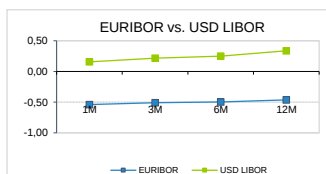
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

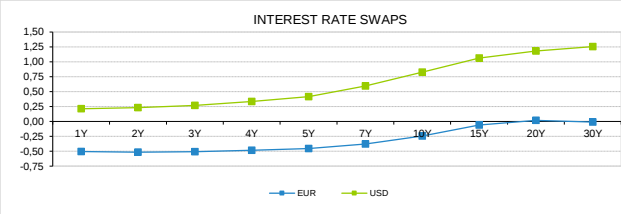
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5390	0	-2	1M	0,1563	1	1	0,0464	-0,7984
3M	-0,5090	0	-1	3M	0,2165	0	-1	0,0451	-0,7658
6M	-0,4960	0	-3	6M	0,2494	0	-2	0,0654	-0,7270
12M	-0,4630	0	-3	12M	0,3366	0	-4	0,1321	-0,6176

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5055	0	-2	-0,5251	-0,4190	-0,2441
2Y	-0,5160	0	-3	-0,5087	-0,3780	-0,1925
3Y	-0,5080	0	-3	-0,4781	-0,3479	-0,1420
4Y	-0,4851	0	-3	-0,4422	-0,2850	-0,0920
5Y	-0,4553	0	-3	-0,4024	-0,2350	-0,0405
7Y	-0,3792	0	-2	-0,3120	-0,1360	0,0450
10Y	-0,2457	0	-1	-0,1720	-0,0100	0,1350
15Y	-0,0590	0	0	-0,0075	0,0932	0,1730
20Y	0,0178	0	0	0,0444	0,0968	0,1326
30Y	-0,0112	0	1	-0,0031	0,0147	0,0230

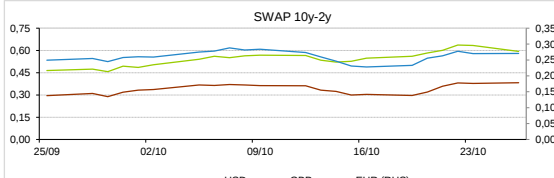
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2124	0	-1	0,2476	0,5287	0,9670
2Y	0,2325	-1	1	0,2937	0,6412	1,0370
3Y	0,2697	-1	3	0,3721	0,7275	1,1210
4Y	0,3335	-2	5	0,4648	0,8340	1,1935
5Y	0,4163	-3	8	0,5530	0,9297	1,2535
7Y	0,5944	-4	10	0,7410	1,0743	1,3235
10Y	0,8257	-5	13	0,9455	1,1935	1,3940
15Y	1,0634	-5	14	1,1355	1,3110	1,4500
20Y	1,1824	-5	15	1,2370	1,3620	1,4485
30Y	1,2554	-4	16	1,2918	1,3598	1,4020

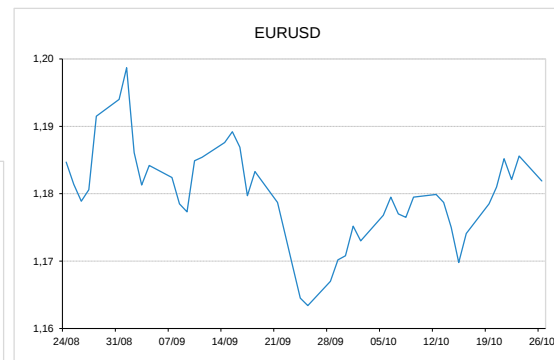
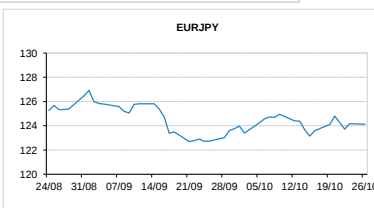
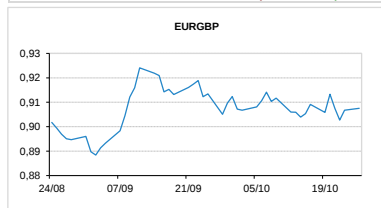


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	40,46	-1,31	-1,95	OT 2Y	-0,558	-0,01	2,60
JETFUEL	337,50	-2,00	26,25	OT 5Y	-0,335	-0,02	-12,00
DIESEL	333,75	-2,25	11,75	OT 10Y	0,159	-0,02	-12,10
COBRE	6.876,00	-55,00	263,00	BUND 10Y	-1,090	-0,54	-6,10
ZINCO	2.549,50	-19,50	153,50	SCHATZ 2Y	-0,176	-0,23	-3,90
OURO	1.904,29	2,24	42,71	T-NOTE 10Y	1,767	-2,54	8,40
TRIGO	621,50	-11,25	77,25	T-NOTE 2Y	0,743	-0,37	2,30
LICENÇA C02	24,24	-1,25	-1,93	GILT 10Y	0,383	-0,69	6,50



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1819	-0,31%	1,28%	1,1846	1,1869	1,1918
EUR/GBP	0,90755	-0,09%	-0,27%	0,9090	0,9103	0,9132
EUR/JPY	124,14	0,02%	-0,90%	124,14	124,14	124,14
EUR/CHF	1,0721	0,06%	0,52%	1,0714	1,0707	1,0693
EUR/BRL	6,6559	0,13%	-0,80%	6,6813	6,7170	6,8375
EUR/PLN	4,5796	-0,16%	0,13%	4,5889	4,5971	4,6143



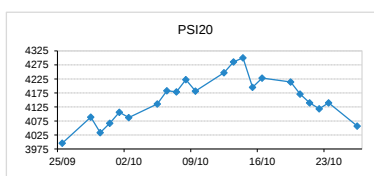
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1819	0,9076	124,14	1,0721	10,3267	7,4404	1,5620	1,66066	6,6559	10,9244
USD	0,8466	-	0,7692	104,985	0,9074	8,7454	6,2988	1,3203	1,4058	5,6221	9,2462

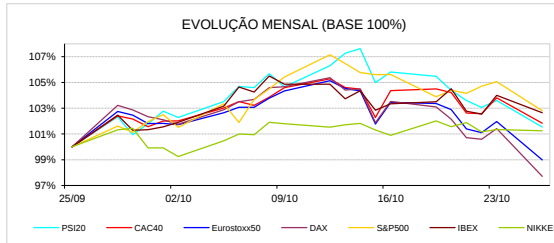
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,398	-4,55	-40,18
BCP	0,075	-2,58	-62,82
CORT. AMORIM	9,970	-1,48	-11,77
CTT	2,250	-2,81	-29,47
EDP	4,315	-1,46	14,26
EDP R	16,020	-0,87	52,57
GALP	7,756	-4,76	-47,95
IBERSOL	3,900	0,26	-51,25
J MARTINS	14,465	0,17	-1,36
MOTA ENGIL	1,138	-3,40	-39,14
NAVIGATOR	1,923	-2,48	-44,24
NOS	3,036	-3,50	-36,75
PHAROL	0,096	-2,85	-4,02
RAMADA	2,970	-0,34	-49,14
REN	2,340	-1,06	-13,97
SEMAPA	6,790	-2,30	-50,51
SONAE CAP.	0,770	0,00	2,26
SONAE SGPS	0,510	-2,21	-44,01

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	0,26
J MARTINS	0,17
PHAROL	-2,85
MOTA ENGIL	-3,40
NOS	-3,50
ALTRI	-4,55
GALP	-4,76



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.057,10	-1,99%	-22,19%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.816,35	-1,90%	-19,43%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.105,29	-2,93%	-17,09%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.183,63	-3,65%	-8,04%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.391,15	-2,15%	4,96%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.803,70	-1,30%	-28,75%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.494,34	-0,09%	-0,69%	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.