

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

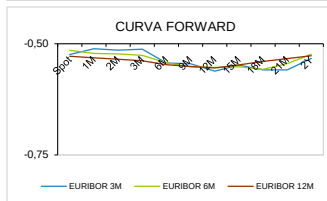
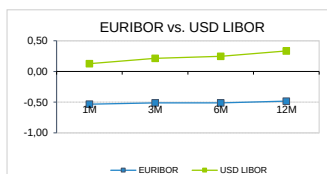
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

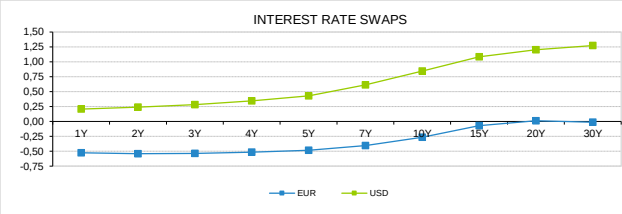
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5330	1	1	1M	0,1266	-1	-2	0,0423	-0,8054
3M	-0,5130	0	-1	3M	0,2130	-2	-1	0,0455	-0,7716
6M	-0,5120	0	-3	6M	0,2463	0	1	0,0589	-0,7352
12M	-0,4830	0	-2	12M	0,3338	0	-2	0,1234	-0,6240

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5272	1	-4	-0,5570	-0,4505	-0,2611
2Y	-0,5413	0	-5	-0,5420	-0,4093	-0,2084
3Y	-0,5367	0	-5	-0,5115	-0,3603	-0,1543
4Y	-0,5148	0	-6	-0,4743	-0,3092	-0,1035
5Y	-0,4845	0	-6	-0,4314	-0,2570	-0,0525
7Y	-0,4050	1	-5	-0,3364	-0,1523	0,0390
10Y	-0,2650	1	-5	-0,1900	-0,0205	0,1324
15Y	-0,0700	2	-4	-0,0194	0,0861	0,1726
20Y	0,0115	2	-4	0,0374	0,0936	0,1346
30Y	-0,0129	3	-3	-0,0051	0,0156	0,0271

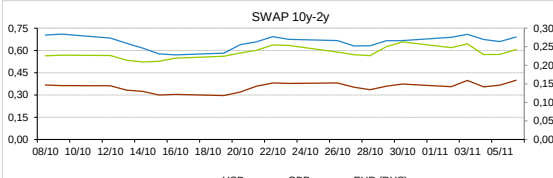
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2070	0	-1	0,2661	0,5317	0,9730
2Y	0,2393	0	1	0,3151	0,6544	1,0475
3Y	0,2807	1	2	0,3901	0,7425	1,1330
4Y	0,3456	2	2	0,4680	0,8075	1,2248
5Y	0,4290	2	3	0,5645	0,9280	1,2802
7Y	0,6123	3	5	0,7510	1,0715	1,3693
10Y	0,8456	4	5	0,9690	1,2155	1,4380
15Y	1,0840	4	6	1,1545	1,3325	1,4570
20Y	1,2021	4	6	1,2676	1,3615	1,4505
30Y	1,2730	4	6	1,3100	1,3768	1,4230

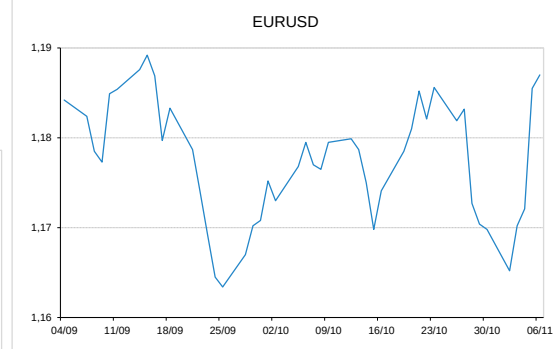
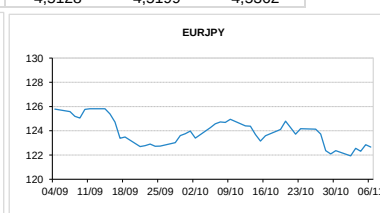
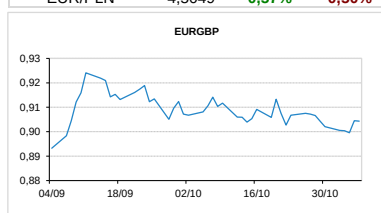


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	39,79	-1,14	-3,34	OT 2Y	-0,621	0,00	-3,80
JETFUEL	339,58	-1,71	9,33	OT 5Y	-0,419	0,01	-14,50
DIESEL	332,08	-1,96	-1,67	OT 10Y	0,080	0,00	-15,30
COBRE	6.865,00	15,00	324,00	BUND 10Y	-1,135	2,07	-12,70
ZINCO	2.604,00	21,00	287,50	SCHATZ 2Y	-0,197	0,68	-7,60
OURO	1.952,72	5,02	48,75	T-NOTE 10Y	1,780	3,38	2,00
TRIGO	605,25	-4,00	12,50	T-NOTE 2Y	0,748	0,56	0,00
LICENÇA C02	25,38	-0,60	-1,41	GILT 10Y	0,379	3,94	-3,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,187	0,13%	0,64%	1,1896	1,1920	1,1971
EUR/GBP	0,9043	0,02%	0,69%	0,9057	0,9071	0,9101
EUR/JPY	122,66	0,16%	1,57%	122,66	122,66	122,66
EUR/CHF	1,0681	0,15%	0,93%	1,0674	1,0668	1,0654
EUR/BRL	6,49	0,94%	1,10%	6,5220	6,5561	6,6809
EUR/PLN	4,5049	0,57%	-0,50%	4,5128	4,5199	4,5362



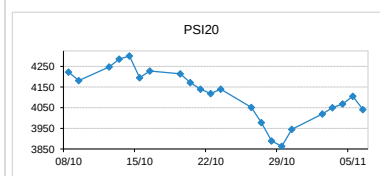
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1870	0,9043	122,66	1,0681	10,2567	7,4514	1,5486	1,63502	6,4900	10,8679
USD	0,8421	-	0,761	103,305	0,8994	8,6445	6,2744	1,3029	1,3754	5,4841	9,1714

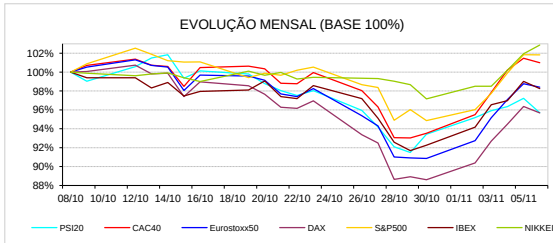
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,422	0,41	-39,75
BCP	0,076	-1,81	-62,48
CORT. AMORIM	10,000	2,56	-11,50
CTT	2,095	-2,56	-34,33
EDP	4,374	-1,60	15,82
EDP R	16,820	-2,55	60,19
GALP	7,036	-1,70	-52,78
IBERSOL	3,820	-2,05	-52,25
J MARTINS	14,115	1,29	-3,75
MOTA ENGIL	1,098	-2,14	-41,28
NAVIGATOR	2,006	-0,20	-41,83
NOS	2,916	-5,81	-39,25
PHAROL	0,099	1,97	-1,10
RAMADA	3,150	0,32	-46,06
REN	2,260	-0,88	-16,91
SEMAPA	6,810	-1,30	-50,36
SONAE CAP.	0,770	0,00	2,26
SONAE SGPS	0,536	-2,64	-41,15

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	2,56
PHAROL	1,97
J MARTINS	1,29
ALTRI	0,41
RAMADA	0,32
MOTA ENGIL	-2,14
EDP R	-2,55
CTT	-2,56
SONAE SGPS	-2,64
NOS	-5,81



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.040,86	-1,57%	-22,50%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.960,88	-0,46%	-17,02%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.204,04	-0,36%	-14,45%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.480,02	-0,70%	-5,80%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.509,58	-0,02%	8,64%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.870,40	-0,78%	-28,05%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	24.325,23	0,91%	2,83%	24.389,00	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.