

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

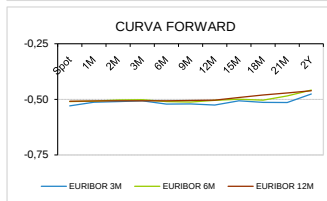
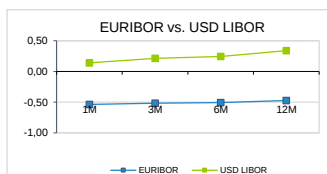
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

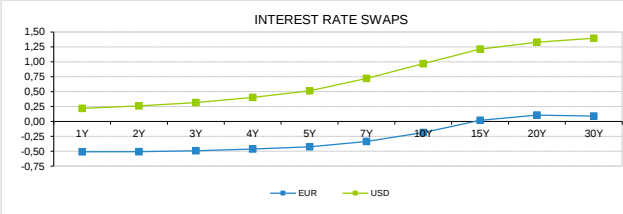
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5370	-1	-1	1M	0,1401	1	-1	0,0425	-0,8068
3M	-0,5180	-1	-1	3M	0,2136	1	-1	0,0446	-0,7688
6M	-0,5070	0	-2	6M	0,2430	0	0	0,0689	-0,7256
12M	-0,4730	0	-1	12M	0,3381	1	-1	0,1380	-0,6118

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5090	0	-1	-0,5048	-0,3792	-0,1653
2Y	-0,5065	0	0	-0,4823	-0,3315	-0,1160
3Y	-0,4915	0	1	-0,4476	-0,2760	-0,0564
4Y	-0,4635	0	1	-0,4060	-0,2240	-0,0020
5Y	-0,4270	-1	2	-0,3590	-0,1680	0,0520
7Y	-0,3367	-1	3	-0,2570	-0,0580	0,1450
10Y	-0,1858	-1	5	-0,1000	0,0800	0,2400
15Y	0,0190	-1	6	0,0778	0,1914	0,2840
20Y	0,1066	-1	7	0,1395	0,2024	0,2488
30Y	0,0901	-1	8	0,1030	0,1277	0,1429

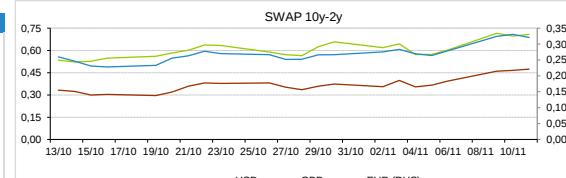
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2190	0	0	0,2899	0,6693	1,2857
2Y	0,2609	0	2	0,3580	0,8142	1,3004
3Y	0,3153	0	4	0,4615	0,9239	1,3283
4Y	0,4030	1	7	0,5861	1,0308	1,4195
5Y	0,5131	2	10	0,6993	1,1172	1,4508
7Y	0,7200	2	14	0,8969	1,2631	1,5300
10Y	0,9697	1	17	1,1235	1,4004	1,5955
15Y	1,2120	1	17	1,3154	1,5077	1,6406
20Y	1,3294	1	18	1,4041	1,5434	1,6363
30Y	1,3960	0	17	1,4395	1,5190	1,5639

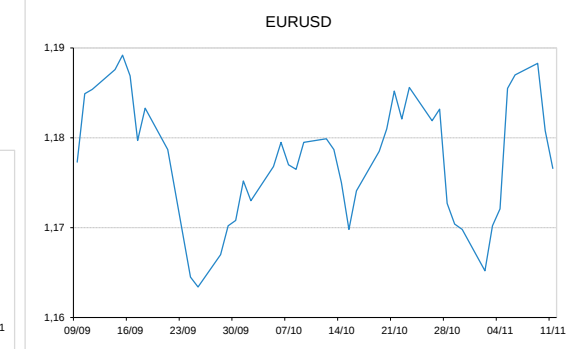
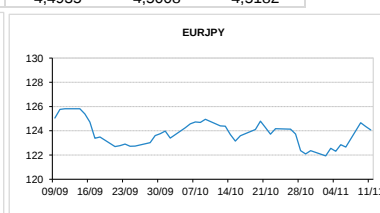


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	44,27	0,66	0,95	OT 2Y	-0,599	0,00	-1,60
JETFUEL	368,13	14,05	24,91	OT 5Y	-0,376	-0,01	-5,50
DIESEL	356,88	12,30	7,24	OT 10Y	0,127	-0,02	-2,80
COBRE	6.961,50	16,00	169,00	BUND 10Y	-1,018	-1,69	3,60
ZINCO	2.628,75	2,25	204,25	SCHATZ 2Y	-0,130	0,23	1,90
OURO	1.863,01	-18,88	-67,39	T-NOTE 10Y	1,874	-0,28	13,10
TRIGO	601,50	-7,00	7,75	T-NOTE 2Y	0,781	0,56	3,50
LICENÇA C02	26,33	0,10	0,62	GILT 10Y	0,519	1,48	13,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1766	-0,36%	-0,28%	1,1793	1,1816	1,1866
EUR/GBP	0,88935	0,28%	1,87%	0,8908	0,8921	0,8951
EUR/JPY	124,07	0,23%	0,27%	124,07	124,07	124,07
EUR/CHF	1,0805	0,08%	-0,61%	1,0798	1,0791	1,0777
EUR/BRL	6,3484	0,67%	3,10%	6,3940	6,4281	6,5498
EUR/PLN	4,4848	0,21%	-0,51%	4,4935	4,5008	4,5182



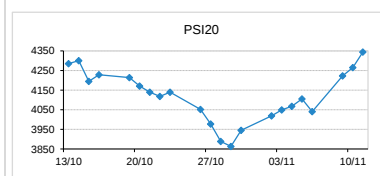
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1766	0,8894	124,07	1,0805	10,1852	7,4459	1,5363	1,61905	6,3484	10,6820
USD	0,8504	-	0,7578	105,62	0,9183	8,6565	6,3324	1,3067	1,3767	5,3938	9,0849

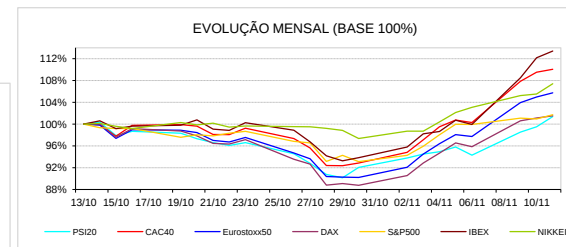
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,842	2,18	-32,36
BCP	0,095	0,85	-53,06
CORT. AMORIM	10,400	-0,57	-7,96
CTT	2,150	0,00	-32,60
EDP	4,582	5,16	21,33
EDP R	17,460	6,85	66,29
GALP	8,814	-0,68	-40,85
IBERSOL	4,380	0,69	-45,25
J MARTINS	14,105	0,82	-3,82
MOTA ENGIL	1,238	4,56	-33,80
NAVIGATOR	2,186	1,96	-36,61
NOS	2,858	-6,60	-40,46
PHAROL	0,102	0,59	2,81
RAMADA	3,200	-2,14	-45,21
REN	2,340	2,86	-13,97
SEMAPA	7,530	1,76	-45,12
SONAE CAP.	0,772	0,26	2,52
SONAE SGPS	0,594	1,63	-34,78

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP R	6,85
EDP	5,16
MOTA ENGIL	4,56
REN	2,86
ALTRI	2,18
CORT. AMORIM	-0,57
GALP	-0,68
RAMADA	-2,14
NOS	-6,60



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.344,68	1,87%	-16,68%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.445,21	0,48%	-8,91%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.467,30	0,72%	-7,42%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.216,18	0,40%	-0,25%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.572,59	0,75%	10,57%	3.645,99	2.191,86
IBEX 35	7.796,70	1,11%	-18,35%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	25.349,60	1,78%	7,16%	25.401,30	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.