

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

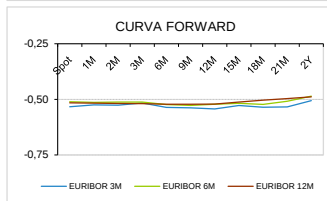
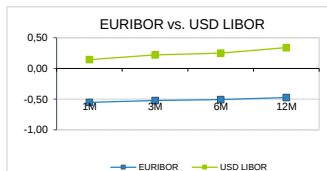
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

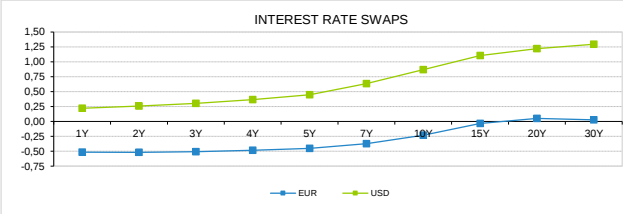
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5520	-2	-2	1M	0,1435	1	-1	0,0419	-0,8042
3M	-0,5220	0	-1	3M	0,2204	0	0	0,0478	-0,7676
6M	-0,5080	0	-1	6M	0,2490	0	-1	0,0676	-0,7260
12M	-0,4740	0	-1	12M	0,3396	0	0	0,1326	-0,6114

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5157	0	0	-0,5230	-0,4115	-0,2277
2Y	-0,5188	0	1	-0,5053	-0,3693	-0,1742
3Y	-0,5087	0	2	-0,4741	-0,3240	-0,1200
4Y	-0,4847	-1	3	-0,4383	-0,2710	-0,0661
5Y	-0,4530	-1	4	-0,3970	-0,2210	-0,0145
7Y	-0,3730	-1	5	-0,3020	-0,1132	0,0828
10Y	-0,2315	-1	7	-0,1530	0,0243	0,1775
15Y	-0,0332	-1	8	0,0220	0,1292	0,2190
20Y	0,0507	-1	9	0,0801	0,1386	0,1800
30Y	0,0275	-1	10	0,0377	0,0592	0,0717

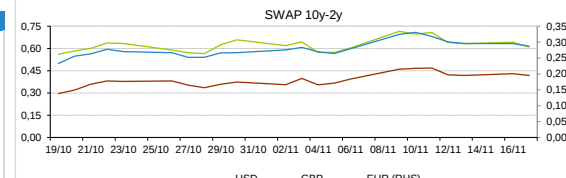
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2208	0	1	0,2905	0,5589	0,9990
2Y	0,2594	-1	3	0,3411	0,6713	1,1112
3Y	0,3020	-1	4	0,4080	0,7880	1,1878
4Y	0,3654	-2	4	0,4980	0,8899	1,2531
5Y	0,4487	-3	5	0,6066	0,9781	1,3082
7Y	0,6345	-3	7	0,7880	1,1213	1,3919
10Y	0,8690	-4	8	0,9920	1,2630	1,4604
15Y	1,1049	-4	9	1,1987	1,3610	1,4900
20Y	1,2213	-4	9	1,2869	1,4166	1,4900
30Y	1,2947	-4	10	1,3316	1,3975	1,4422

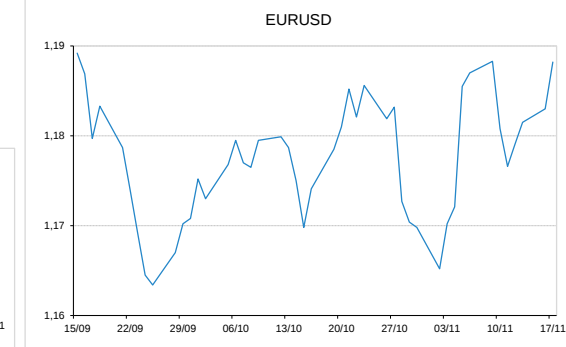
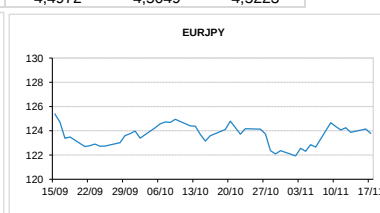
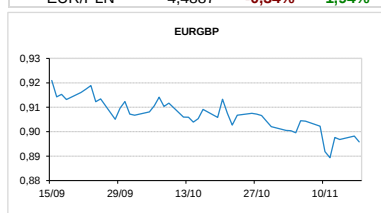


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	43,18	-0,64	-0,09	OT 2Y	-0,666	-0,04	-6,40
JETFUEL	360,50	7,25	18,33	OT 5Y	-0,429	-0,03	-6,70
DIESEL	352,25	7,25	6,17	OT 10Y	0,044	-0,03	-7,00
COBRE	7.095,00	125,50	368,00	BUND 10Y	-1,078	-1,62	6,00
ZINCO	2.669,00	49,50	237,00	SCHATZ 2Y	-0,140	0,00	5,70
OURO	1.886,22	-3,22	-13,07	T-NOTE 10Y	1,800	-2,26	7,10
TRIGO	601,75	-3,00	-21,75	T-NOTE 2Y	0,767	-0,56	3,00
LICENÇA C02	26,97	-0,42	2,08	GILT 10Y	0,429	-2,42	14,50



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1882	0,44%	0,82%	1,1909	1,1932	1,1982
EUR/GBP	0,89585	0,26%	1,12%	0,8972	0,8986	0,9015
EUR/JPY	123,78	0,30%	0,27%	123,78	123,78	123,78
EUR/CHF	1,0806	-0,03%	-0,84%	1,0799	1,0792	1,0778
EUR/BRL	6,3479	1,40%	3,98%	6,3781	6,4122	6,5330
EUR/PLN	4,4887	-0,34%	1,94%	4,4972	4,5049	4,5223



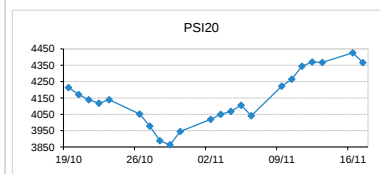
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1882	0,8959	123,78	1,0806	10,2349	7,4475	1,5534	1,62481	6,3479	10,7559
USD	0,8421	-	0,7543	104,215	0,9106	8,6273	6,2711	1,3097	1,3699	5,3585	9,0678

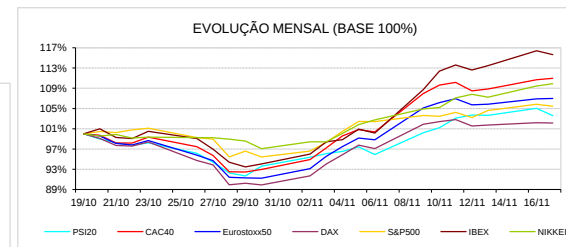
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,020	-0,94	-29,23
BCP	0,104	-2,08	-48,96
CORT. AMORIM	10,100	-1,94	-10,62
CTT	2,315	0,87	-27,43
EDP	4,456	-1,13	17,99
EDP R	16,980	-1,16	61,71
GALP	8,990	-1,60	-39,66
IBERSOL	4,490	-2,81	-43,88
J MARTINS	13,950	-1,24	-4,88
MOTA ENGIL	1,366	3,80	-26,95
NAVIGATOR	2,260	-2,33	-34,46
NOS	2,830	-1,53	-41,04
PHAROL	0,107	0,19	7,43
RAMADA	3,410	-0,87	-41,61
REN	2,270	-2,16	-16,54
SEMAPA	7,850	-1,38	-42,78
SONAE CAP.	0,770	0,00	2,26
SONAE SGPS	0,625	-0,48	-31,32

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
MOTA ENGIL	3,80
CTT	0,87
PHAROL	0,19
CORT. AMORIM	-1,94
BCP	-2,08
REN	-2,16
NAVIGATOR	-2,33
IBERSOL	-2,81



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.366,00	-1,36%	-16,27%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.484,57	0,24%	-8,26%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.469,02	0,08%	-7,37%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.129,62	-0,07%	-0,90%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.615,04	-0,38%	11,84%	3.645,99	2.191,86
IBEX 35	7.934,20	-0,65%	-16,91%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	26.014,62	0,42%	9,97%	26.057,30	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.