

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

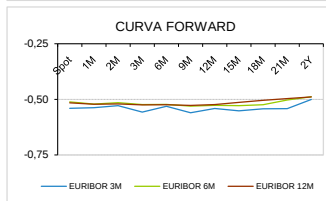
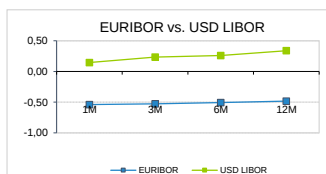
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

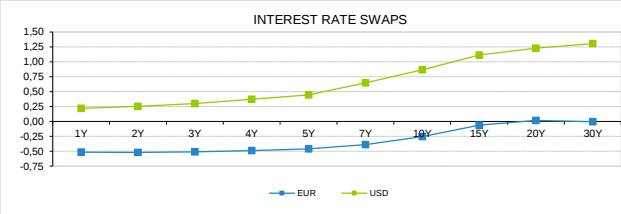
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5390	-1	0	1M	0,1455	0	-1	0,0394	-0,8062
3M	-0,5280	0	-2	3M	0,2330	0	2	0,0440	-0,7754
6M	-0,5060	0	-1	6M	0,2600	1	1	0,0633	-0,7276
12M	-0,4830	0	-2	12M	0,3374	0	0	0,1358	-0,6124

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5165	-1	-1	-0,5257	-0,4263	-0,2628
2Y	-0,5195	0	0	-0,5067	-0,3870	-0,2089
3Y	-0,5102	0	0	-0,4794	-0,3453	-0,1574
4Y	-0,4886	0	0	-0,4464	-0,2977	-0,1068
5Y	-0,4606	-1	0	-0,4092	-0,2490	-0,0558
7Y	-0,3882	-1	0	-0,3218	-0,1491	0,0383
10Y	-0,2560	-2	-1	-0,1809	-0,0150	0,1331
15Y	-0,0640	-2	0	-0,0125	0,0895	0,1765
20Y	0,0170	-2	0	0,0449	0,0993	0,1425
30Y	-0,0058	-2	1	0,0041	0,0230	0,0340

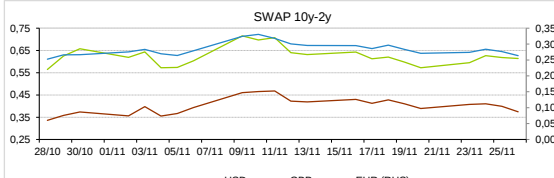
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2197	0	1	0,2845	0,5822	1,0652
2Y	0,2533	0	2	0,3405	0,6670	1,1828
3Y	0,3010	0	3	0,4206	0,8133	1,2337
4Y	0,3707	1	4	0,5027	0,9124	1,2989
5Y	0,4461	0	3	0,6225	1,0044	1,3089
7Y	0,6471	1	6	0,8111	1,1443	1,4159
10Y	0,8672	-1	4	1,0236	1,2650	1,4749
15Y	1,1140	1	5	1,2092	1,3876	1,5246
20Y	1,2294	1	5	1,2982	1,4270	1,5235
30Y	1,3066	1	6	1,3443	1,4132	1,4580

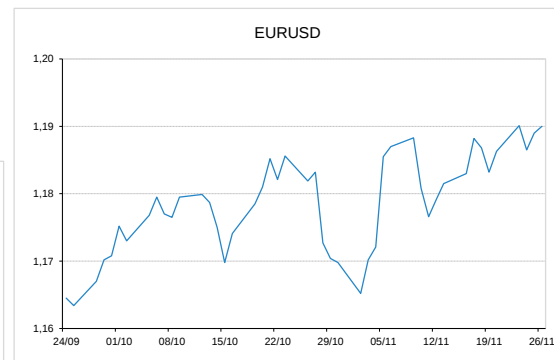
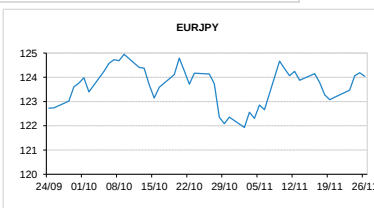
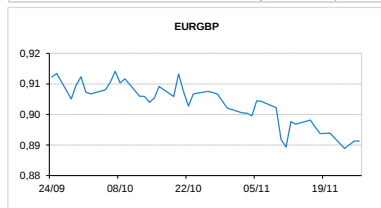


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	47,61	-1,00	6,80	OT 2Y	-0,687	0,00	-11,50
JETFUEL	406,25	10,25	68,75	OT 5Y	-0,459	-0,01	-8,70
DIESEL	398,00	9,25	64,25	OT 10Y	0,008	-0,01	-12,30
COBRE	7.326,00	7,00	432,50	BUND 10Y	-1,103	-1,41	2,70
ZINCO	2.741,25	-3,00	187,25	SCHATZ 2Y	-0,160	-0,23	3,00
OURO	1.810,16	1,50	-92,44	T-NOTE 10Y	1,784	-1,70	3,50
TRIGO	596,50	-21,00	-36,00	T-NOTE 2Y	0,748	-0,19	0,70
LICENÇA C02	28,21	0,59	4,36	GILT 10Y	0,463	-3,12	4,20



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,19	0,08%	0,69%	1,1927	1,1951	1,2001
EUR/GBP	0,89129	0,00%	1,82%	0,8926	0,8941	0,8970
EUR/JPY	124,04	0,12%	0,08%	124,04	124,04	124,04
EUR/CHF	1,0794	0,28%	-0,67%	1,0787	1,0779	1,0765
EUR/BRL	6,3296	0,16%	4,92%	6,3580	6,3977	6,5304
EUR/PLN	4,4746	-0,21%	2,32%	4,4823	4,4900	4,5078



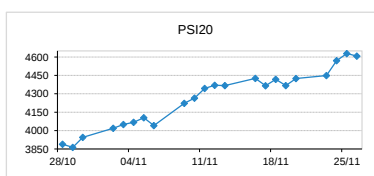
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1900	0,8913	124,04	1,0794	10,1522	7,4427	1,5494	1,6172	6,3296	10,5679
USD	0,8402	-	0,7501	104,285	0,9072	8,5354	6,2539	1,3021	1,3583	5,3175	8,8761

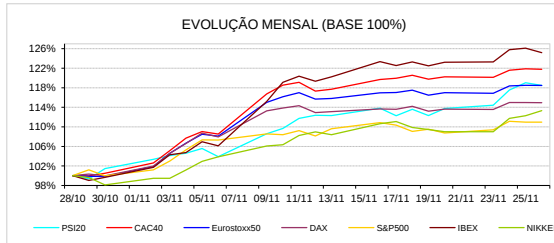
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,450	0,91	-21,65
BCP	0,119	-2,94	-41,42
CORT. AMORIM	10,260	-1,16	-9,20
CTT	2,460	-1,99	-22,88
EDP	4,530	0,53	19,95
EDP R	17,300	-1,14	64,76
GALP	9,500	-2,24	-36,24
IBERSOL	5,040	8,39	-37,00
J MARTINS	14,125	-0,32	-3,68
MOTA ENGIL	1,498	2,46	-19,89
NAVIGATOR	2,492	2,21	-27,74
NOS	3,120	-0,13	-35,00
PHAROL	0,123	10,99	23,69
RAMADA	3,640	-0,55	-37,67
REN	2,300	-0,22	-15,44
SEMAPA	8,960	0,90	-34,69
SONAE CAP.	#N/A Real	#N/A	2,26
SONAE SGPS	0,676	0,30	-25,71

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	10,99
IBERSOL	8,39
MOTA ENGIL	2,46
NAVIGATOR	2,21
ALTRI	0,91
EDP R	-1,14
CORT. AMORIM	-1,16
CTT	-1,99
GALP	-2,24
BCP	-2,94



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.607,25	-0,46%	-11,64%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.566,79	-0,08%	-6,88%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.510,94	-0,03%	-6,25%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.286,57	-0,02%	0,28%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.629,65	-0,16%	12,35%	3.645,99	2.191,86
IBEX 35	8.104,60	-0,74%	-15,13%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	26.537,31	0,91%	12,18%	26.706,42	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.