

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

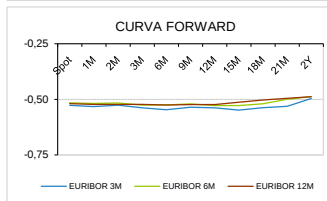
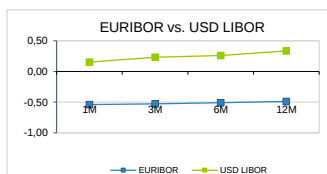
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

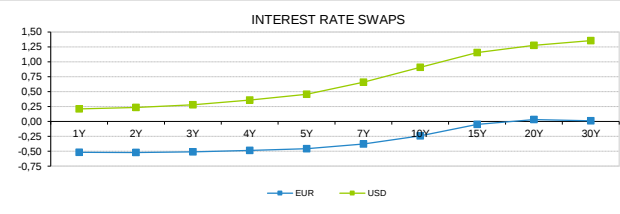
INTERBANK OFFERED RATE									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5390	1	0	1M	0,1521	0	1	0,0356	-0,8408
3M	-0,5270	0	-1	3M	0,2305	0	1	0,0411	-0,7814
6M	-0,5100	0	0	6M	0,2583	0	1	0,0595	-0,7296
12M	-0,4880	0	0	12M	0,3344	0	0	0,1321	-0,6112

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5187	1	1	-0,5244	-0,4196	-0,2393
2Y	-0,5213	-1	2	-0,5056	-0,3789	-0,1875
3Y	-0,5102	-1	2	-0,4767	-0,3322	-0,1387
4Y	-0,4872	-1	2	-0,4427	-0,2830	-0,0855
5Y	-0,4570	-1	2	-0,4020	-0,2345	-0,0310
7Y	-0,3790	-2	2	-0,3118	-0,1310	0,0563
10Y	-0,2420	-2	1	-0,1680	-0,0010	0,1485
15Y	-0,0510	-2	2	0,0014	0,1054	0,1910
20Y	0,0310	-2	3	0,0595	0,1165	0,1589
30Y	0,0120	-1	4	0,0217	0,0421	0,0536

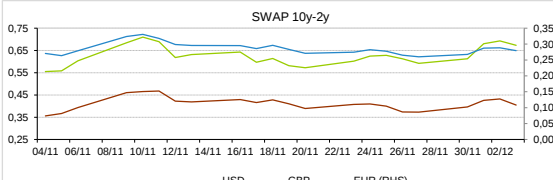
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2104	0	-1	0,2511	0,5770	1,0884
2Y	0,2337	0	-1	0,3078	0,7214	1,1660
3Y	0,2789	0	-1	0,4025	0,8270	1,2540
4Y	0,3574	-1	0	0,5070	0,9330	1,3140
5Y	0,4543	-1	0	0,6180	1,0325	1,3820
7Y	0,6585	-2	0	0,8210	1,1670	1,4470
10Y	0,9070	-2	0	1,0515	1,3155	1,5155
15Y	1,1553	-2	1	1,2506	1,4315	1,5680
20Y	1,2771	-2	2	1,3360	1,4880	1,5660
30Y	1,3557	-2	3	1,3825	1,4625	1,5080

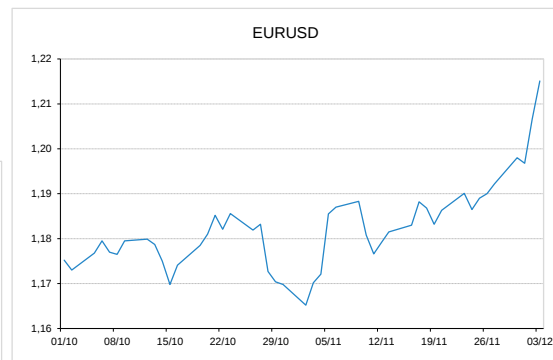
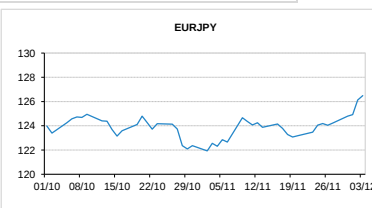
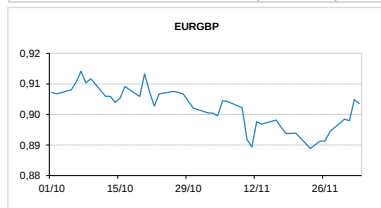


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	48,35	0,10	8,20	OT 2Y	-0,703	0,00	-9,10
JETFUEL	409,28	6,65	91,67	OT 5Y	-0,426	-0,01	-0,40
DIESEL	395,79	7,16	79,68	OT 10Y	0,034	-0,03	-4,80
COBRE	7.675,00	-21,50	911,00	BUND 10Y	-1,071	-3,91	6,40
ZINCO	2.729,25	-25,25	196,00	SCHATZ 2Y	-0,144	-1,60	6,60
OURO	1.833,91	2,62	-75,26	T-NOTE 10Y	1,858	-1,99	0,70
TRIGO	580,00	-8,50	-30,00	T-NOTE 2Y	0,756	-0,74	-0,30
LICENÇA C02	29,03	-0,52	4,64	GILT 10Y	0,513	-2,52	5,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2151	0,70%	3,84%	1,2180	1,2204	1,2255
EUR/GBP	0,90358	0,15%	-0,35%	0,9050	0,9065	0,9095
EUR/JPY	126,49	-0,28%	-3,11%	126,49	126,49	126,49
EUR/CHF	1,0823	0,15%	-1,22%	1,0817	1,0810	1,0796
EUR/BRL	6,2297	1,62%	8,04%	6,2555	6,2888	6,4021
EUR/PLN	4,4698	0,11%	1,93%	4,4780	4,4857	4,5032



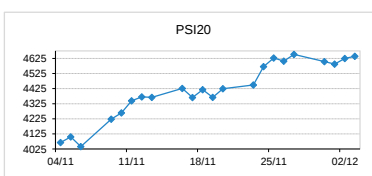
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2151	0,9036	126,49	1,0823	10,2623	7,4435	1,5644	1,63268	6,2297	10,6443
USD	0,8224	-	0,7409	103,765	0,8905	8,4369	6,1212	1,2874	1,3435	5,1315	8,7554

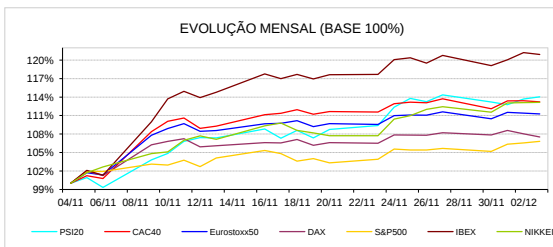
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,926	1,90	-13,27
BCP	0,120	-0,42	-40,98
CORT. AMORIM	10,240	-0,78	-9,38
CTT	2,520	1,41	-21,00
EDP	4,575	0,82	21,15
EDP R	17,940	1,47	70,86
GALP	8,858	-2,10	-40,55
IBERSOL	5,160	1,57	-35,50
J MARTINS	13,970	0,32	-4,74
MOTA ENGIL	1,406	-0,57	-24,81
NAVIGATOR	2,542	-0,31	-26,29
NOS	3,268	2,96	-31,92
PHAROL	0,124	2,48	24,50
RAMADA	3,730	0,27	-36,13
REN	2,305	0,00	-15,26
SEMAPA	9,090	1,00	-33,75
SONAE CAP.	#N/A Real	#N/A	2,26
SONAE SGPS	0,668	-2,05	-26,65

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
NOS	2,96
PHAROL	2,48
ALTRI	1,90
IBERSOL	1,57
EDP R	1,47
BCP	-0,42
MOTA ENGIL	-0,57
CORT. AMORIM	-0,78
SONAE SGPS	-2,05
GALP	-2,10



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.639,14	0,32%	-11,03%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.574,36	-0,15%	-6,75%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.517,10	-0,12%	-6,09%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.252,86	-0,45%	0,03%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.677,30	0,24%	13,83%	3.681,45	2.191,86
IBEX 35	8.200,70	-0,24%	-14,12%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	26.809,37	0,03%	13,33%	26.889,90	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.