

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

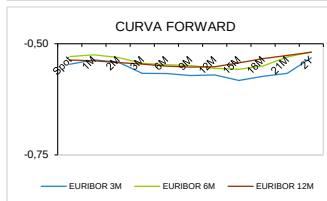
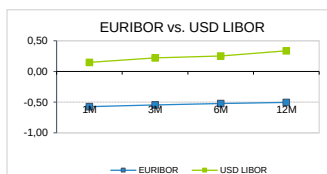
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

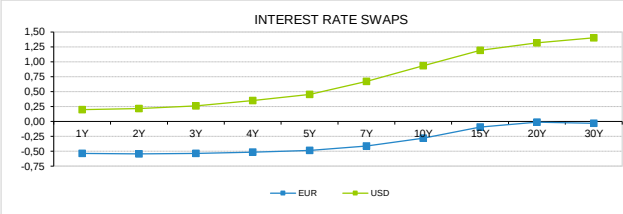
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5730	-2	-5	1M	0,1479	0	2	0,0240	-0,8470
3M	-0,5460	0	-4	3M	0,2206	-1	2	0,0369	-0,7904
6M	-0,5230	0	-2	6M	0,2508	0	1	0,0395	-0,7428
12M	-0,5040	0	-3	12M	0,3359	0	0	0,1123	-0,6234

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5370	0	-3	-0,5531	-0,4590	-0,2850
2Y	-0,5441	0	-4	-0,5354	-0,4180	-0,2351
3Y	-0,5360	0	-5	-0,5082	-0,3730	-0,1822
4Y	-0,5148	0	-5	-0,4753	-0,3261	-0,1310
5Y	-0,4870	0	-7	-0,4372	-0,2757	-0,0790
7Y	-0,4140	0	-9	-0,3489	-0,1753	0,0075
10Y	-0,2810	-1	-11	-0,2087	-0,0480	0,0987
15Y	-0,0940	-1	-12	-0,0423	0,0602	0,1422
20Y	-0,0120	-1	-13	0,0145	0,0695	0,1104
30Y	-0,0305	-1	-13	-0,0225	-0,0029	0,0078

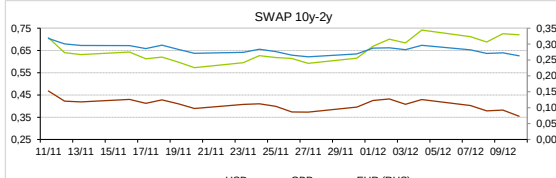
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,1980	-1	-2	0,2329	0,5870	1,1185
2Y	0,2152	-1	-4	0,2941	0,7428	1,2160
3Y	0,2618	-1	-5	0,3870	0,8590	1,2900
4Y	0,3492	-1	-4	0,5156	0,9585	1,3750
5Y	0,4528	-2	-4	0,6375	1,0735	1,4443
7Y	0,6709	-2	-3	0,8470	1,2215	1,4940
10Y	0,9355	-2	-2	1,0745	1,3705	1,5775
15Y	1,1931	-2	-1	1,2860	1,4865	1,6260
20Y	1,3192	-2	0	1,3815	1,5170	1,6265
30Y	1,4030	-2	1	1,4338	1,5281	1,5794

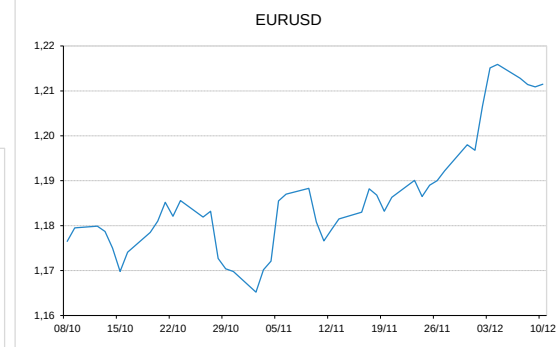
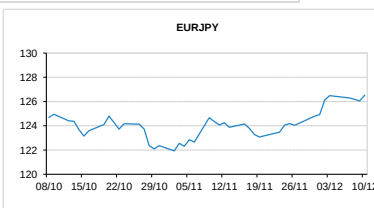
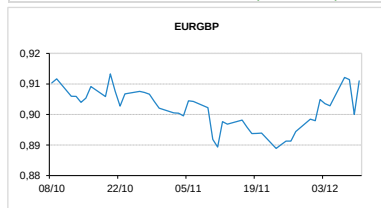


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	50,89	2,03	6,98	OT 2Y	-0,718	0,01	-12,00
JETFUEL	417,55	-2,35	63,47	OT 5Y	-0,471	0,00	-10,40
DIESEL	405,30	-1,60	60,72	OT 10Y	-0,019	0,00	-16,80
COBRE	7.691,50	24,00	807,00	BUND 10Y	-1,273	0,59	-12,40
ZINCO	2.829,50	54,25	198,00	SCHATZ 2Y	-0,183	0,68	-3,40
OURO	1.836,48	-5,44	-45,40	T-NOTE 10Y	1,852	-0,71	-6,30
TRIGO	596,50	13,25	-19,75	T-NOTE 2Y	0,741	-0,93	-4,00
LICENÇA C02	30,66	0,96	4,43	GILT 10Y	0,386	-5,34	-19,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2115	0,05%	2,60%	1,2144	1,2169	1,2221
EUR/GBP	0,911	-1,21%	-2,10%	0,9124	0,9139	0,9168
EUR/JPY	126,53	-0,38%	-1,72%	126,53	126,53	126,53
EUR/CHF	1,0761	-0,11%	0,39%	1,0755	1,0747	1,0734
EUR/BRL	6,1342	1,76%	4,18%	6,1627	6,1988	6,3202
EUR/PLN	4,4258	0,18%	1,50%	4,4344	4,4432	4,4630



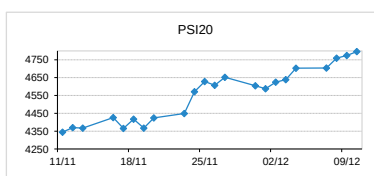
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2115	0,9110	126,53	1,0761	10,2403	7,4439	1,5412	1,61206	6,1342	10,6282
USD	0,8244	-	0,7532	104,395	0,8871	8,4416	6,1363	1,2718	1,3305	5,0620	8,7607

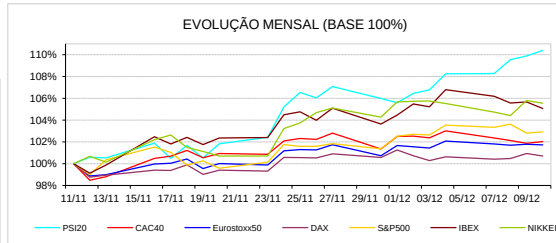
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,250	0,57	-7,57
BCP	0,127	-1,48	-37,48
CORT. AMORIM	10,400	0,19	-7,96
CTT	2,520	-1,18	-21,00
EDP	4,765	1,66	26,18
EDP R	18,500	0,00	76,19
GALP	9,308	1,59	-37,53
IBERSOL	5,320	3,10	-33,50
J MARTINS	14,560	1,29	-0,72
MOTA ENGIL	1,406	-2,09	-24,81
NAVIGATOR	2,508	0,56	-23,12
NOS	3,204	-1,17	-33,21
PHAROL	0,142	7,58	42,57
RAMADA	4,170	12,10	-28,60
REN	2,355	0,64	-13,42
SEMAPA	9,760	0,93	-28,86
SONAE CAP.	#N/A Real	#N/A	2,26
SONAE SGPS	0,706	0,36	-22,47

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
RAMADA	12,10
PHAROL	7,58
IBERSOL	3,10
EDP	1,66
GALP	1,59
NOS	-1,17
CTT	-1,18
BCP	-1,48
MOTA ENGIL	-2,09



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.796,09	0,46%	-8,02%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.555,47	0,16%	-7,07%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.527,19	-0,05%	-5,82%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.308,40	-0,23%	0,46%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.677,04	0,12%	13,81%	3.712,39	2.191,86
IBEX 35	8.187,60	-0,58%	-14,26%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	26.756,24	-0,23%	13,10%	26.894,25	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.