

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

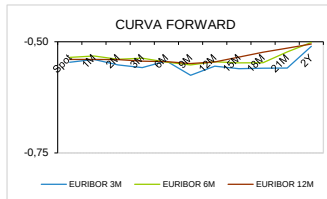
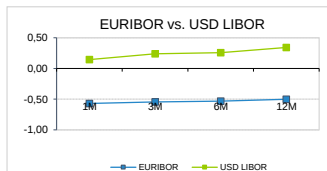
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

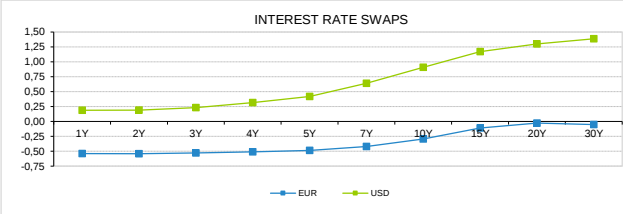
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5700	-2	-3	1M	0,1439	0	-1	0,0191	-0,8134
3M	-0,5460	0	-1	3M	0,2384	0	1	0,0255	-0,7638
6M	-0,5320	-1	-2	6M	0,2576	0	0	0,0299	-0,7246
12M	-0,5020	0	-1	12M	0,3419	0	1	0,0843	-0,6104

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5397	-1	-2	-0,5462	-0,4550	-0,3057
2Y	-0,5415	-2	-1	-0,5247	-0,4245	-0,2595
3Y	-0,5295	-2	-1	-0,5005	-0,3840	-0,2135
4Y	-0,5107	-3	-2	-0,4740	-0,3415	-0,1625
5Y	-0,4860	-3	-3	-0,4395	-0,2975	-0,1080
7Y	-0,4200	-3	-4	-0,3610	-0,1985	-0,0180
10Y	-0,2950	-3	-6	-0,2250	-0,0685	0,0740
15Y	-0,1091	-3	-7	-0,0601	0,0386	0,1220
20Y	-0,0274	-3	-7	-0,0025	0,0481	0,0870
30Y	-0,0530	-3	-8	-0,0457	-0,0296	-0,0210

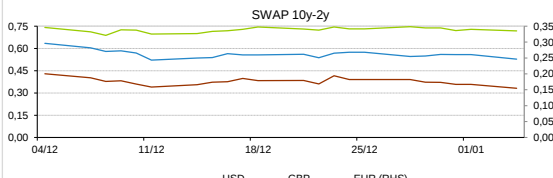
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,1872	-1	-2	0,1958	0,5470	1,1110
2Y	0,1891	-1	-4	0,2565	0,7023	1,2075
3Y	0,2326	-1	-5	0,3470	0,8356	1,2898
4Y	0,3153	-1	-6	0,4700	0,9522	1,3593
5Y	0,4185	-1	-6	0,5910	1,0502	1,4201
7Y	0,6402	-1	-6	0,8204	1,1920	1,5118
10Y	0,9072	-2	-7	1,0611	1,3643	1,5620
15Y	1,1721	-2	-6	1,2630	1,4680	1,6110
20Y	1,2990	-1	-6	1,3620	1,5100	1,6120
30Y	1,3866	-2	-6	1,4296	1,5127	1,5645

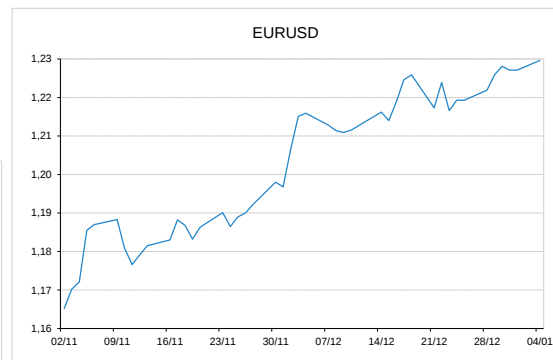
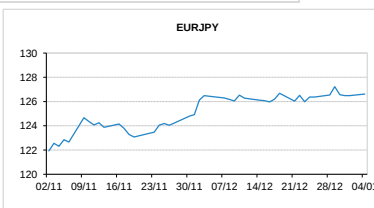
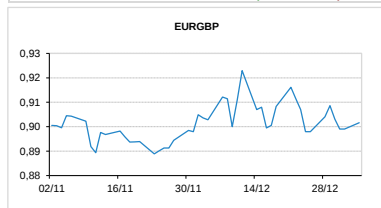


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	51,08	-0,72	1,89	OT 2Y	-0,718	0,01	-1,50
JETFUEL	438,83	-3,42	36,20	OT 5Y	-0,441	-0,01	-1,50
DIESEL	425,78	-2,97	37,15	OT 10Y	0,011	-0,02	-2,30
COBRE	7.753,50	-81,50	186,00	BUND 10Y	-1,282	-3,89	-6,30
ZINCO	2.733,33	-34,42	-50,62	SCHATZ 2Y	-0,146	-2,06	1,20
OURO	1.938,02	39,35	99,16	T-NOTE 10Y	1,813	-0,57	-4,40
TRIGO	636,00	-4,50	60,50	T-NOTE 2Y	0,707	-0,18	-4,70
LICENÇA C02	33,71	0,99	3,40	GILT 10Y	0,357	-1,89	-15,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2296	0,20%	1,13%	1,2320	1,2345	1,2398
EUR/GBP	0,9016	-0,29%	0,14%	0,9029	0,9043	0,9070
EUR/JPY	126,62	-0,10%	-0,14%	126,62	126,62	126,62
EUR/CHF	1,0798	0,16%	0,11%	1,0791	1,0784	1,0771
EUR/BRL	6,444	-1,54%	-3,47%	6,4761	6,5169	6,6444
EUR/PLN	4,5498	0,27%	-1,76%	4,5563	4,5642	4,5828



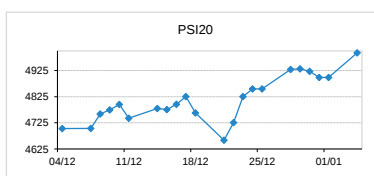
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2296	0,9016	126,62	1,0798	10,1129	7,4402	1,5671	1,60159	6,4440	10,5140
USD	0,8150	-	0,7364	103,135	0,8799	8,2221	6,0633	1,2742	1,3017	5,2112	8,5337

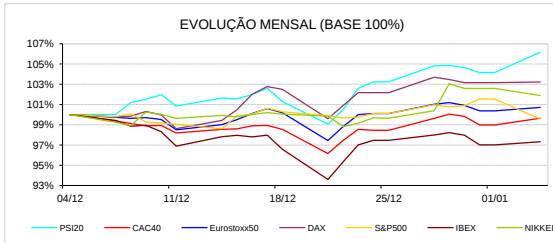
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,190	0,58	0,58
BCP	0,125	1,70	1,70
CORT. AMORIM	11,580	-0,17	-0,17
CTT	2,370	0,85	0,85
EDP	5,372	4,19	4,19
EDP R	24,050	5,48	5,48
GALP	8,500	-2,90	-2,90
IBERSOL	5,300	-1,85	-1,85
J MARTINS	14,105	2,06	2,06
MOTA ENGIL	1,378	1,03	1,03
NAVIGATOR	2,488	-0,40	-0,40
NOVABASE	3,250	1,25	1,25
NOS	2,906	1,68	1,68
PHAROL	0,130	4,33	4,33
REN	2,390	1,06	1,06
SEMAPA	8,950	-0,56	-0,56
SONAE SGPS	0,661	-0,08	-0,08

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP R	5,48
PHAROL	4,33
EDP	4,19
J MARTINS	2,06
BCP	1,70
CORT. AMORIM	-0,17
NAVIGATOR	-0,40
SEMAPA	-0,56
IBERSOL	-1,85
GALP	-2,90



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.993,00	1,93%	1,93%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.588,96	0,68%	0,68%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.564,39	0,33%	0,33%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.726,74	0,06%	0,06%	13.907,13	8.255,65
S&P 500	3.683,69	-1,93%	-1,93%	3.769,99	2.191,86
IBEX 35	8.099,20	0,32%	0,32%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	27.258,38	-0,68%	-0,68%	27.602,52	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.