

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

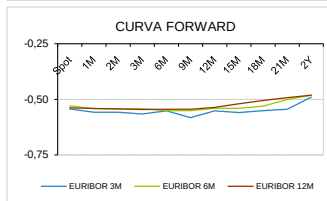
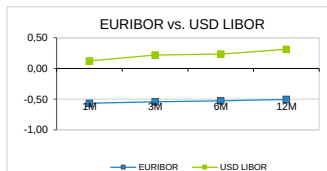
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

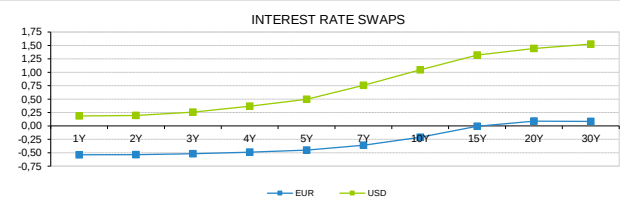
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5670	0	0	1M	0,1225	-1	-2	0,0289	-0,8110
3M	-0,5430	0	0	3M	0,2185	1	-2	0,0354	-0,7594
6M	-0,5260	0	-1	6M	0,2345	0	-3	0,0425	-0,7224
12M	-0,5050	0	-1	12M	0,3115	0	-3	0,0818	-0,6100

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5379	-1	-2	-0,5373	-0,4101	-0,1967
2Y	-0,5375	-1	-3	-0,5118	-0,3547	-0,1413
3Y	-0,5182	-1	-3	-0,4758	-0,3020	-0,0860
4Y	-0,4900	-2	-2	-0,4326	-0,2479	-0,0311
5Y	-0,4525	-1	0	-0,3854	-0,1932	0,0280
7Y	-0,3615	-1	2	-0,2829	-0,0836	0,1157
10Y	-0,2130	-1	4	-0,1293	0,0534	0,2120
15Y	-0,0073	0	6	0,0522	0,1698	0,2665
20Y	0,0885	0	8	0,1223	0,1903	0,2428
30Y	0,0850	1	10	0,0983	0,1264	0,1432

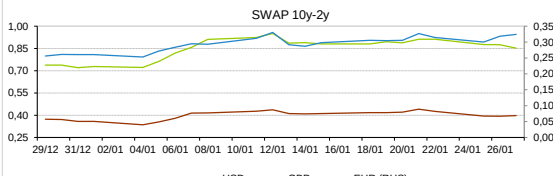
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,1849	-1	-1	0,2078	0,6875	1,2865
2Y	0,1942	-1	-2	0,2850	0,8440	1,3960
3Y	0,2560	-1	0	0,4317	0,9885	1,4960
4Y	0,3672	-1	2	0,5615	1,1165	1,5690
5Y	0,4950	-2	4	0,7080	1,2270	1,6295
7Y	0,7562	-2	7	0,9680	1,3800	1,6775
10Y	1,0461	-3	9	1,2035	1,5545	1,7540
15Y	1,3202	-3	10	1,4374	1,6602	1,7860
20Y	1,4439	-4	9	1,5035	1,6931	1,7790
30Y	1,5245	-4	9	1,5520	1,6625	1,7153

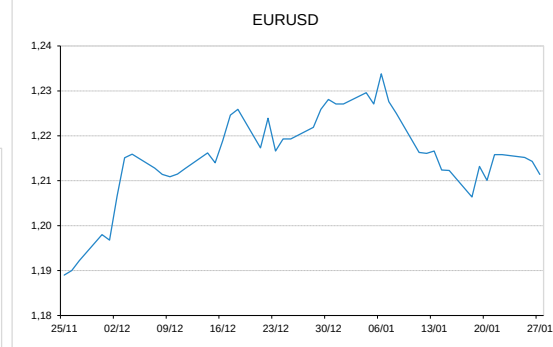
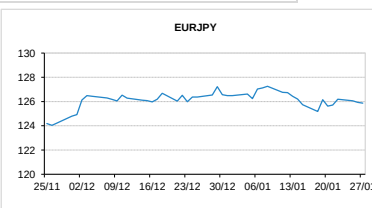
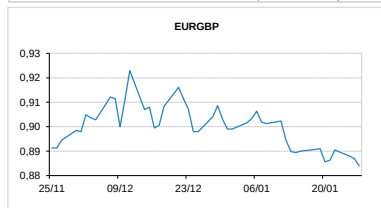


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	56,24	0,33	4,90	OT 2Y	-0,671	0,00	4,80
JETFUEL	464,25	-2,50	23,75	OT 5Y	-0,448	0,00	-0,30
DIESEL	454,00	-1,00	27,50	OT 10Y	0,022	0,00	-1,30
COBRE	7.995,00	39,50	221,00	BUND 10Y	-1,252	-1,72	-2,50
ZINCO	2.639,50	-50,25	-195,00	SCHATZ 2Y	-0,156	-1,60	-3,90
OURO	1.847,27	-5,45	-32,46	T-NOTE 10Y	1,867	-1,57	3,50
TRIGO	654,75	-10,50	27,75	T-NOTE 2Y	0,706	-0,74	-0,90
LICENÇA C02	33,05	-0,30	0,86	GILT 10Y	0,450	-0,26	1,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2114	-0,24%	-0,86%	1,2138	1,2163	1,2218
EUR/GBP	0,88395	0,34%	2,28%	0,8853	0,8867	0,8895
EUR/JPY	125,87	0,05%	0,53%	125,87	125,87	125,87
EUR/CHF	1,0759	0,25%	0,98%	1,0752	1,0745	1,0732
EUR/BRL	6,5557	-0,62%	-2,24%	6,5931	6,6434	6,8008
EUR/PLN	4,5466	0,04%	-1,16%	4,5510	4,5565	4,5718



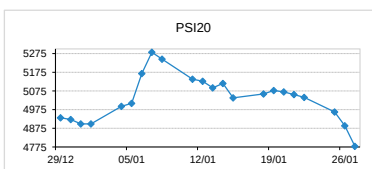
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2114	0,8840	125,87	1,0759	10,1026	7,4375	1,5460	1,5753	6,5557	10,4415
USD	0,8270	-	0,7297	104,105	0,8896	8,3629	6,1508	1,2772	1,3010	5,4117	8,6328

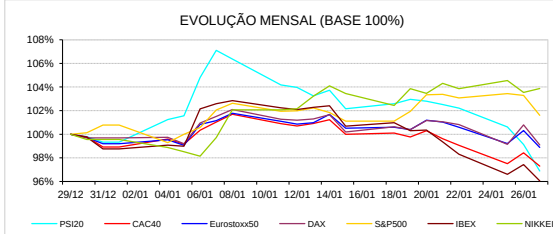
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,924	-2,69	-4,57
BCP	0,113	-1,91	-8,20
CORT. AMORIM	10,680	-2,02	-7,93
CTT	2,330	-3,12	-0,85
EDP	5,096	-2,30	-1,16
EDP R	22,150	-5,14	-2,85
GALP	8,578	-0,49	-2,01
IBERSOL	4,900	-0,61	-9,26
J MARTINS	13,825	-1,43	0,04
MOTA ENGIL	1,380	-0,72	1,17
NAVIGATOR	2,446	-1,37	-2,08
NOVABASE	3,280	-1,80	2,18
NOS	2,834	-0,91	-0,84
PHAROL	0,124	-2,83	-0,80
REN	2,360	0,21	-0,21
SEMAPA	8,820	0,34	-2,00
SONAE SGPS	0,678	-1,24	2,42

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SEMAPA	0,34
REN	0,21
EDP	-2,30
ALTRI	-2,69
PHAROL	-2,83
CTT	-3,12
EDP R	-5,14



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.785,06	-2,26%	-2,45%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.461,15	-1,14%	-1,64%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.539,07	-1,43%	-0,32%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.632,05	-1,69%	-0,59%	14.131,52	8.255,65
S&P 500	3.787,14	-1,63%	0,82%	3.870,90	2.191,86
IBEX 35	7.852,10	-1,42%	-2,74%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	28.635,21	0,31%	4,34%	28.979,53	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.