

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

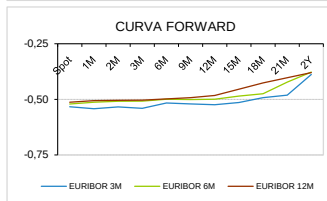
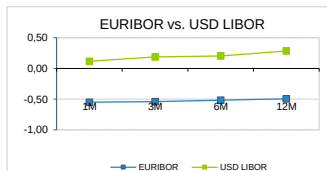
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

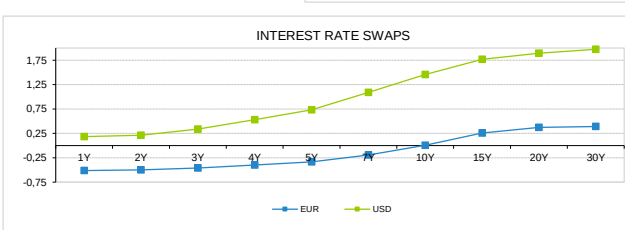
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5490	0	1	1M	0,1176	0	-1	0,0410
3M	-0,5390	0	0	3M	0,1875	1	-3	0,0614
6M	-0,5180	0	1	6M	0,2038	0	-3	0,0781
12M	-0,4940	0	0	12M	0,2846	0	-3	0,1301
								CHF LIBOR
								-0,7924
								-0,7490
								-0,7006
								-0,5902

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,5125	0	2	-0,4830	-0,2286	0,0780	
2Y	-0,4974	0	3	-0,4311	-0,1480	0,1500	
3Y	-0,4587	0	5	-0,3628	-0,0720	0,2190	
4Y	-0,4000	0	8	-0,2888	0,0010	0,2840	
5Y	-0,3332	0	12	-0,2143	0,0730	0,3433	
7Y	-0,1937	0	17	-0,0700	0,2040	0,4500	
10Y	0,0070	1	23	0,1260	0,3630	0,5560	
15Y	0,2578	1	29	0,3432	0,5002	0,6150	
20Y	0,3735	1	31	0,4284	0,5257	0,5910	
30Y	0,3910	1	34	0,4180	0,4674	0,4971	

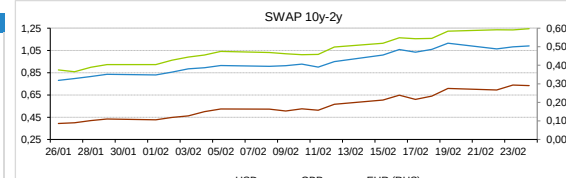
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,1837	0	-1	0,2458	1,0790	1,9040
2Y	0,2119	0	1	0,4050	1,3200	2,0297
3Y	0,3380	1	8	0,6265	1,5232	2,1220
4Y	0,5318	1	16	0,8729	1,6440	2,1908
5Y	0,7315	1	22	1,0645	1,7590	2,2451
7Y	1,0899	2	31	1,3625	1,9345	2,2895
10Y	1,4572	2	38	1,6700	2,1150	2,3215
15Y	1,7675	2	41	1,8930	2,1700	2,3220
20Y	1,8942	1	42	1,9805	2,2259	2,3395
30Y	1,9745	1	41	2,0180	2,1838	2,2386

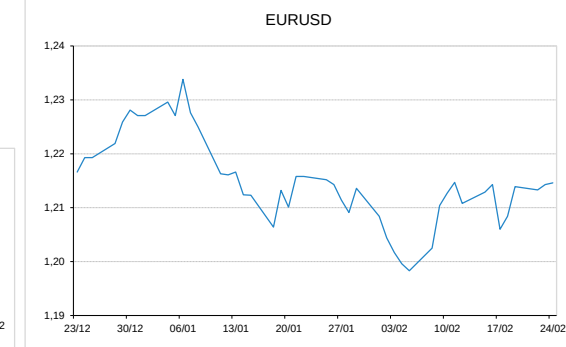
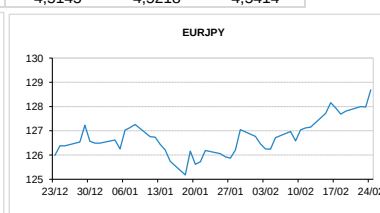


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	66,97	1,60	11,72	OT 2Y	-0,563	0,01	9,40
JETFUEL	548,50	4,00	86,50	OT 5Y	-0,195	0,02	23,90
DIESEL	537,25	3,25	87,50	OT 10Y	0,283	0,03	26,10
COBRE	9.250,00	109,50	1.209,00	BUND 10Y	-1,008	1,49	24,80
ZINCO	2.842,25	-46,00	132,75	SCHATZ 2Y	-0,101	0,00	4,10
OURO	1.799,17	-7,81	-56,44	T-NOTE 10Y	2,081	1,89	19,90
TRIGO	680,25	10,00	44,25	T-NOTE 2Y	0,713	0,55	0,00
LICENÇA C02	39,13	0,46	4,89	GILT 10Y	0,892	1,62	44,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2146	0,02%	-0,05%	1,2170	1,2193	1,2245
EUR/GBP	0,8603	0,32%	3,22%	0,8617	0,8632	0,8661
EUR/JPY	128,69	-0,55%	-2,04%	128,69	128,69	128,69
EUR/CHF	1,1019	-0,37%	-2,13%	1,1013	1,1007	1,0995
EUR/BRL	6,5765	0,51%	0,94%	6,6119	6,6650	6,8169
EUR/PLN	4,5090	-0,04%	0,73%	4,5145	4,5218	4,5414



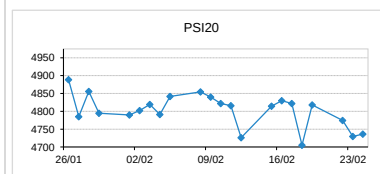
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2146	0,8603	128,69	1,1019	10,0820	7,4365	1,5215	1,5304	6,5765	10,2248
USD	0,8252	-	0,7092	105,98	0,9093	8,3148	6,1368	1,2566	1,2630	5,4256	8,4495

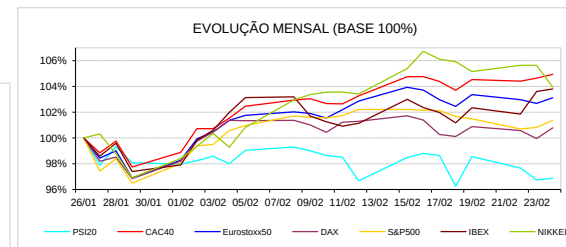
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,185	2,66	19,86
BCP	0,120	0,76	-2,60
CORT. AMORIM	11,080	-1,42	-4,48
CTT	2,520	2,23	7,23
EDP	4,730	0,36	-8,26
EDP R	18,400	-2,13	-19,30
GALP	9,392	2,00	7,29
IBERSOL	5,320	1,14	-1,48
J MARTINS	12,960	-0,27	-6,22
MOTA ENGIL	1,444	0,70	5,87
NAVIGATOR	2,838	2,68	13,61
NOVABASE	3,910	1,30	21,81
NOS	2,736	-0,65	-4,27
PHAROL	0,125	0,48	0,32
REN	2,280	0,22	-3,59
SEMAPA	12,020	-0,83	33,56
SONAE SGPS	0,671	-0,89	1,44

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
NAVIGATOR	2,68
ALTRI	2,66
CTT	2,23
GALP	2,00
NOVABASE	1,30
NOS	-0,65
SEMAPA	-0,83
SONAE SGPS	-0,89
CORT. AMORIM	-1,42
EDP R	-2,13



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.735,99	0,14%	-3,31%	5.317,89	3.500,02
CAC40	5.796,37	0,29%	4,41%	5.884,86	3.632,06
ESTX 50 PR	3.705,13	0,43%	4,29%	3.762,35	2.302,84
XTRA DAX	13.979,83	0,83%	1,90%	14.169,49	8.255,65
S&P 500	3.903,24	0,55%	3,90%	3.950,43	2.191,86
IBEX 35	8.267,90	0,19%	2,41%	9.676,80	5.814,50
NIKKEI 225	29.671,70	-1,61%	8,12%	30.714,52	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.