

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

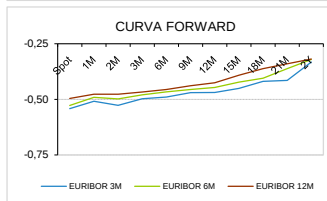
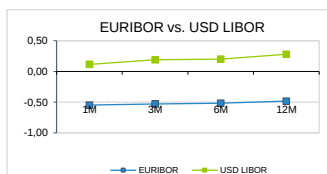
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

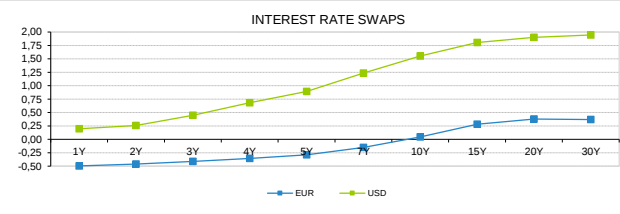
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5470	1	2	1M	0,1151	0	-1	0,0436	-0,7986
3M	-0,5300	1	1	3M	0,1905	0	-2	0,0628	-0,7440
6M	-0,5160	0	1	6M	0,2006	0	-3	0,0833	-0,6966
12M	-0,4830	1	2	12M	0,2803	0	-3	0,1393	-0,5876

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4954	0	3	-0,4269	-0,1851	0,1227
2Y	-0,4609	0	6	-0,3728	-0,1043	0,1964
3Y	-0,4130	-1	9	-0,3090	-0,0282	0,2612
4Y	-0,3550	-2	12	-0,2400	0,0467	0,3240
5Y	-0,2899	-3	15	-0,1670	0,1153	0,3831
7Y	-0,1510	-4	20	-0,0270	0,2433	0,4735
10Y	0,0456	-5	25	0,1610	0,3920	0,5695
15Y	0,2816	-5	29	0,3611	0,5019	0,6045
20Y	0,3778	-6	29	0,4266	0,5132	0,5675
30Y	0,3698	-7	29	0,3926	0,4324	0,4542

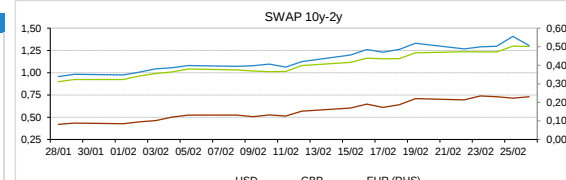
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,1966	1	1	0,3236	1,4068	2,0324
2Y	0,2569	1	6	0,5620	1,5670	2,1050
3Y	0,4470	2	18	0,8498	1,7270	2,1580
4Y	0,6820	3	30	1,0717	1,8310	2,2120
5Y	0,8931	3	38	1,2500	1,9160	2,2757
7Y	1,2332	3	45	1,5338	2,0440	2,2880
10Y	1,5530	0	48	1,7570	2,1843	2,3070
15Y	1,8055	-3	45	1,9390	2,1850	2,2780
20Y	1,9011	-5	42	1,9930	2,2080	2,2460
30Y	1,9450	-8	38	1,9915	2,1172	2,1525

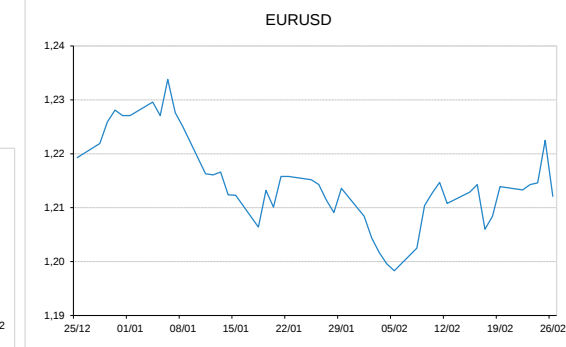
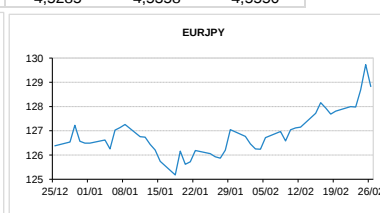


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	66,17	-0,71	10,53	OT 2Y	-0,526	-0,01	14,50
JETFUEL	555,25	-3,99	88,50	OT 5Y	-0,155	-0,03	29,40
DIESEL	542,25	-4,76	87,25	OT 10Y	0,319	-0,05	29,80
COBRE	9.355,00	104,00	1.443,50	BUND 10Y	-0,950	-1,43	30,40
ZINCO	2.879,50	44,00	181,00	SCHATZ 2Y	-0,076	-0,92	8,00
OURO	1.721,90	-51,47	-130,82	T-NOTE 10Y	2,352	2,23	39,30
TRIGO	666,00	-9,75	1,75	T-NOTE 2Y	0,780	0,56	6,90
LICENÇA C02	37,50	-0,76	4,15	GILT 10Y	1,083	5,14	54,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2121	-0,85%	-0,18%	1,2146	1,2170	1,2221
EUR/GBP	0,87053	-0,74%	1,89%	0,8720	0,8735	0,8765
EUR/JPY	128,83	0,70%	-2,25%	128,83	128,83	128,83
EUR/CHF	1,0994	0,51%	-1,89%	1,0988	1,0983	1,0973
EUR/BRL	6,7412	-0,40%	-3,38%	6,7805	6,8389	7,0018
EUR/PLN	4,5224	-0,10%	0,57%	4,5285	4,5358	4,5550



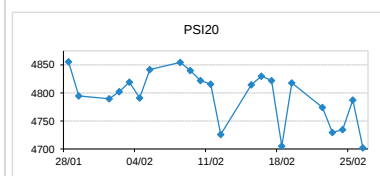
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2121	0,8705	128,83	1,0994	10,1853	7,4360	1,5361	1,5671	6,7412	10,4635
USD	0,8240	-	0,7152	106,56	0,9054	8,3989	6,1268	1,2657	1,2912	5,5697	8,6068

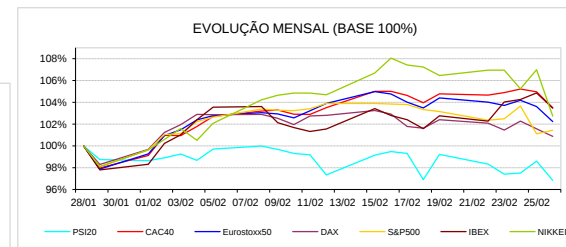
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,045	-1,39	17,15
BCP	0,117	-2,82	-4,87
CORT. AMORIM	10,960	-1,26	-5,52
CTT	2,500	-0,20	6,38
EDP	4,746	-1,56	-7,95
EDP R	18,100	-2,06	-20,61
GALP	9,284	-3,97	6,05
IBERSOL	5,740	1,77	6,30
J MARTINS	12,850	-1,38	-7,02
MOTA ENGIL	1,464	-1,21	7,33
NAVIGATOR	2,812	-1,13	12,57
NOVABASE	3,700	-7,27	15,26
NOS	2,774	-0,93	-2,94
PHAROL	0,122	-2,24	-1,92
REN	2,270	-0,22	-4,02
SEMAPA	11,900	-0,50	32,22
SONAE SGPS	0,680	-2,09	2,80

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	1,77
SONAE SGPS	-2,09
PHAROL	-2,24
BCP	-2,82
GALP	-3,97
NOVABASE	-7,27



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.701,96	-1,78%	-4,01%	5.317,89	3.500,02
CAC40	5.703,22	-1,39%	2,73%	5.834,36	3.632,06
ESTX 50 PR	3.636,44	-1,33%	2,36%	3.742,53	2.302,84
XTRA DAX	13.786,29	-0,67%	0,49%	14.169,49	8.255,65
S&P 500	3.844,73	0,33%	2,28%	3.950,43	2.191,86
IBEX 35	8.207,60	-1,32%	1,66%	9.362,80	5.814,50
NIKKEI 225	28.966,01	-3,99%	5,55%	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.