

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

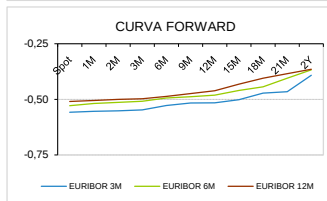
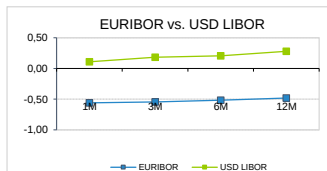
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

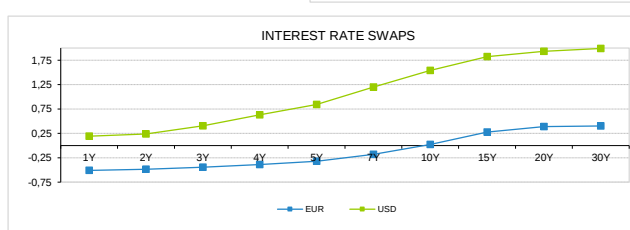
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5600	-1	1	1M	0,1084	0	-1	0,0480	-0,8000
3M	-0,5460	-1	0	3M	0,1834	0	-1	0,0673	-0,7476
6M	-0,5170	0	0	6M	0,2068	1	-1	0,0925	-0,6962
12M	-0,4820	1	3	12M	0,2790	0	-3	0,1503	-0,5822

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,5095	0	2	-0,4645	-0,2238	0,0929	
2Y	-0,4863	1	4	-0,4138	-0,1421	0,1695	
3Y	-0,4453	2	5	-0,3493	-0,0636	0,2386	
4Y	-0,3888	3	7	-0,2766	0,0137	0,3054	
5Y	-0,3230	4	9	-0,2027	0,0859	0,3680	
7Y	-0,1810	5	13	-0,0555	0,2217	0,4724	
10Y	0,0237	6	17	0,1423	0,3827	0,5774	
15Y	0,2757	7	20	0,3595	0,5146	0,6318	
20Y	0,3898	8	21	0,4410	0,5370	0,6038	
30Y	0,4017	8	22	0,4267	0,4744	0,5031	

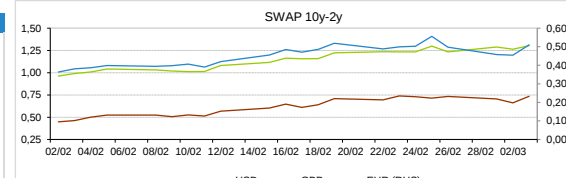
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS			
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	0,1925	1	1	0,2855	1,3050	2,0160	
2Y	0,2368	2	4	0,4860	1,4965	2,1467	
3Y	0,4049	3	13	0,7290	1,6875	2,2165	
4Y	0,6307	4	21	0,9860	1,8050	2,2662	
5Y	0,8412	5	27	1,2116	1,9298	2,3038	
7Y	1,1996	5	33	1,4905	2,0701	2,3626	
10Y	1,5401	6	35	1,7525	2,1827	2,3932	
15Y	1,8230	5	35	1,9620	2,2310	2,3460	
20Y	1,9315	4	33	2,0305	2,2445	2,3403	
30Y	1,9908	4	31	2,0475	2,1926	2,2210	

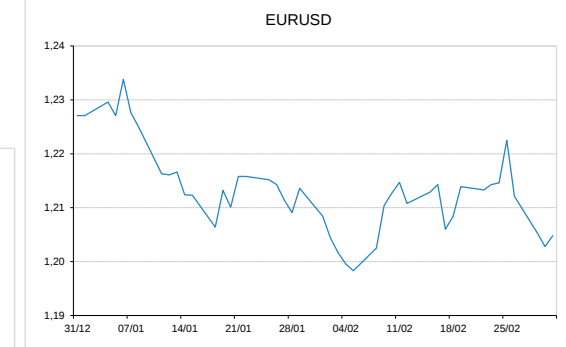
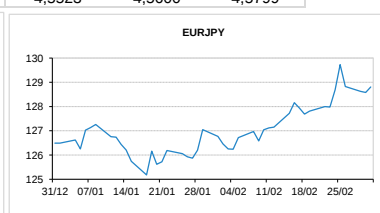


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,23	1,53	6,06	OT 2Y	-0,538	0,03	13,90
JETFUEL	528,10	-3,80	39,06	OT 5Y	-0,191	0,05	25,90
DIESEL	515,85	-4,05	39,31	OT 10Y	0,282	0,06	24,90
COBRE	9.276,50	126,50	1.393,50	BUND 10Y	-0,990	5,48	22,50
ZINCO	2.835,25	33,50	276,25	SCHATZ 2Y	-0,096	1,14	4,60
OURO	1.718,39	-18,41	-117,60	T-NOTE 10Y	2,289	5,17	29,60
TRIGO	652,25	-14,00	1,50	T-NOTE 2Y	0,748	2,04	3,90
LICENÇA C02	37,48	-0,87	0,05	GILT 10Y	1,030	7,30	44,20



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2048	0,17%	0,26%	1,2073	1,2096	1,2148
EUR/GBP	0,86351	0,10%	2,08%	0,8650	0,8665	0,8696
EUR/JPY	128,81	-0,18%	-1,99%	128,81	128,81	128,81
EUR/CHF	1,1083	-0,23%	-2,36%	1,1078	1,1072	1,1061
EUR/BRL	6,9562	-1,58%	-6,97%	7,0039	7,0727	7,2580
EUR/PLN	4,5461	-0,11%	-1,30%	4,5523	4,5600	4,5799



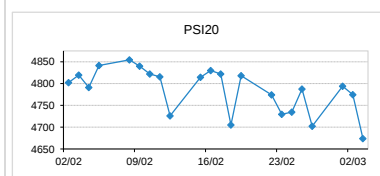
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2048	0,8635	128,81	1,1083	10,1463	7,4361	1,5227	1,54605	6,9562	10,2334
USD	0,8283	-	0,7157	106,985	0,9174	8,4023	6,1590	1,2627	1,2823	5,7552	8,4835

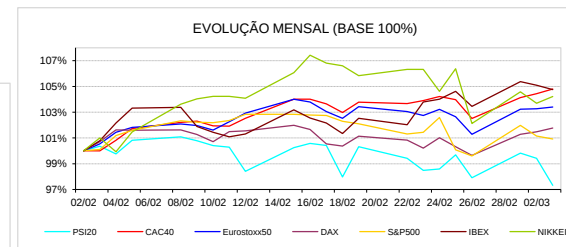
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,135	0,33	18,90
BCP	0,120	-0,25	-2,35
CORT. AMORIM	11,040	0,36	-4,83
CTT	2,560	0,59	8,94
EDP	4,550	-4,63	-11,75
EDP R	16,880	-9,93	-25,96
GALP	9,740	0,70	11,26
IBERSOL	6,080	1,00	12,59
J MARTINS	12,950	-0,04	-6,30
MOTA ENGIL	1,470	-0,81	7,77
NAVIGATOR	2,842	0,42	13,77
NOVABASE	3,540	-2,48	10,28
NOS	2,744	0,22	-3,99
PHAROL	0,122	0,49	-2,24
REN	2,275	-0,44	-3,81
SEMAPA	12,020	0,84	33,56
SONAE SGPS	0,681	0,29	2,95

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	1,00
SEMAPA	0,84
GALP	0,70
CTT	0,59
PHAROL	0,49
REN	-0,44
MOTA ENGIL	-0,81
NOVABASE	-2,48
EDP	-4,63
EDP R	-9,93



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.673,70	-2,11%	-4,59%	5.317,89	3.500,02
CAC40	5.830,06	0,35%	5,02%	5.871,43	3.632,06
ESTX 50 PR	3.712,78	0,14%	4,51%	3.742,53	2.302,84
XTRA DAX	14.080,03	0,29%	2,63%	14.197,49	8.255,65
S&P 500	3.861,11	-0,23%	2,80%	3.950,43	2.191,86
IBEX 35	8.329,30	-0,32%	3,17%	9.014,30	5.814,50
NIKKEI 225	29.559,10	0,51%	7,71%	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.