

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

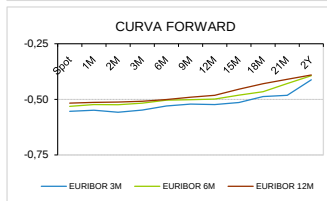
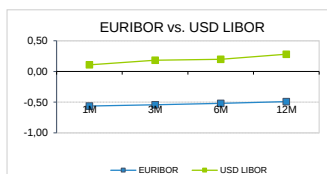
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

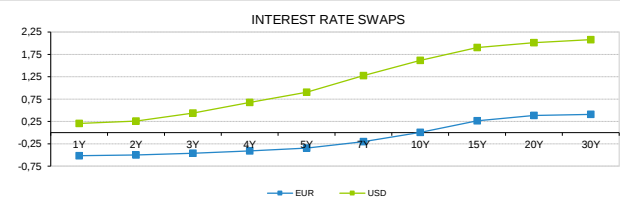
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5630	-1	-1	1M	0,1075	0	0	0,0504	-0,8018
3M	-0,5420	0	0	3M	0,1820	-1	-1	0,0803	-0,7522
6M	-0,5200	-1	0	6M	0,1975	0	-1	0,0971	-0,7078
12M	-0,4910	-1	1	12M	0,2810	0	-2	0,1560	-0,5888

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5164	-1	0	-0,4857	-0,2463	0,0760
2Y	-0,4992	-1	0	-0,4376	-0,1750	0,1530
3Y	-0,4632	-1	1	-0,3731	-0,0910	0,2230
4Y	-0,4087	-1	1	-0,3042	-0,0110	0,2920
5Y	-0,3465	-1	1	-0,2280	0,0640	0,3602
7Y	-0,2030	-1	1	-0,0780	0,2033	0,4635
10Y	0,0047	-1	2	0,1250	0,3690	0,5724
15Y	0,2645	-1	3	0,3494	0,5105	0,6346
20Y	0,3853	-1	3	0,4387	0,5401	0,6125
30Y	0,4075	-1	3	0,4332	0,4831	0,5151

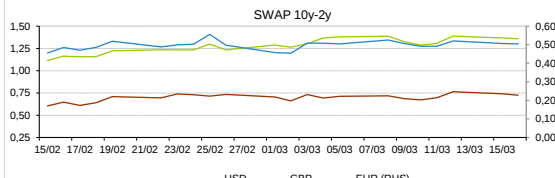
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2050	0	2	0,3090	1,3850	2,1586
2Y	0,2558	0	4	0,5533	1,5985	2,2571
3Y	0,4357	-1	12	0,8220	1,7555	2,2800
4Y	0,6763	-1	19	1,0611	1,9298	2,3587
5Y	0,9016	-2	22	1,2902	2,0264	2,3965
7Y	1,2735	-1	26	1,5878	2,1145	2,4080
10Y	1,6144	-1	24	1,8558	2,2741	2,4295
15Y	1,9010	0	22	2,0330	2,2930	2,4035
20Y	2,0130	0	21	2,0850	2,3423	2,4010
30Y	2,0795	1	19	2,0965	2,2650	2,2665

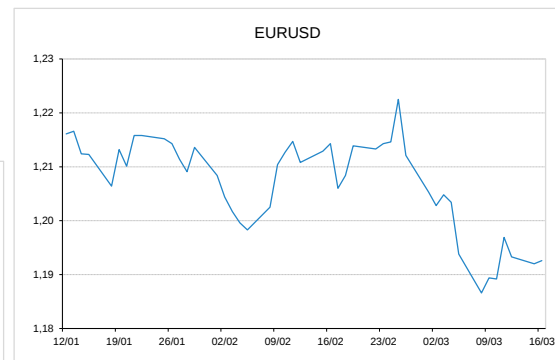
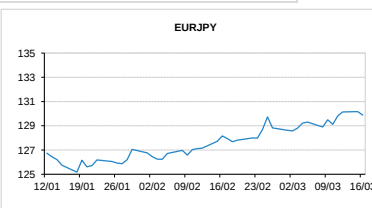
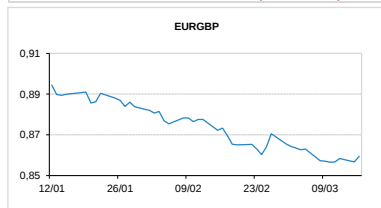


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	68,20	-0,68	5,44	OT 2Y	-0,598	0,00	0,00
JETFUEL	561,00	-7,45	25,50	OT 5Y	-0,264	0,01	4,60
DIESEL	547,25	-6,75	26,75	OT 10Y	0,197	0,02	9,00
COBRE	9 116,50	59,50	751,00	BUND 10Y	-0,847	0,07	9,00
ZINCO	2 847,25	55,00	9,00	SCHATZ 2Y	-0,046	0,23	2,50
OURO	1 730,96	1,56	-65,76	T-NOTE 10Y	2,383	-0,60	32,70
TRIGO	643,75	-1,25	-17,75	T-NOTE 2Y	0,763	-0,19	4,60
LICENÇA C02	41,67	-0,72	2,81	GILT 10Y	1,035	-0,82	25,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1926	0,05%	-1,79%	1,1949	1,1974	1,2026
EUR/GBP	0,85945	-0,32%	1,62%	0,8609	0,8624	0,8655
EUR/JPY	129,88	0,22%	-1,32%	129,88	129,88	129,88
EUR/CHF	1,1018	0,49%	-1,93%	1,1011	1,1005	1,0993
EUR/BRL	6,6322	1,06%	-1,73%	6,6788	6,7485	6,9361
EUR/PLN	4,5980	-0,23%	-2,23%	4,6041	4,6117	4,6306



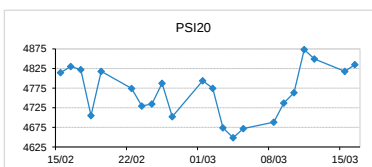
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1926	0,8595	129,88	1,1018	10,1324	7,4359	1,4808	1,53524	6,6322	10,0897
USD	0,8398	-	0,72	108,895	0,9260	8,5242	6,2446	1,2466	1,2906	5,5614	8,4765

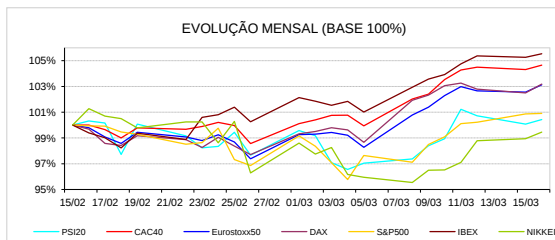
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,950	-0,67	15,31
BCP	0,115	0,00	-6,98
CORT. AMORIM	10,600	-0,56	-8,62
CTT	2,920	1,57	24,26
EDP	4,837	1,72	-6,19
EDP R	17,980	1,70	-21,14
GALP	10,430	-1,88	19,15
IBERSOL	5,800	0,00	7,41
J MARTINS	13,335	0,08	-3,51
MOTA ENGIL	1,478	-0,27	8,36
NAVIGATOR	2,770	-1,21	10,89
NOVABASE	3,540	-0,28	10,28
NOS	3,066	3,37	7,28
PHAROL	0,119	-0,83	-4,65
REN	2,350	0,21	-0,63
SEMAPA	11,900	0,17	32,22
SONAE SGPS	0,717	-0,97	8,39

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOS	3,37
EDP	1,72
EDP R	1,70
CTT	1,57
REN	0,21
ALTRI	-0,67
PHAROL	-0,83
SONAE SGPS	-0,97
NAVIGATOR	-1,21
GALP	-1,88



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4 835,17	0,36%	-1,29%	5 317,89	3 500,02
CAC40	6 055,43	0,32%	9,08%	6 089,20	3 632,06
ESTX 50 PR	3 850,96	0,55%	8,40%	3 857,07	2 302,84
XTRA DAX	14 557,58	0,66%	6,11%	14 601,79	8 255,65
S&P 500	3 971,98	0,04%	5,71%	3 981,04	2 191,86
IBEX 35	8 657,70	0,26%	7,23%	8 740,10	5 814,50
NIKKEI 225	29 921,09	0,52%	9,03%	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.