

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

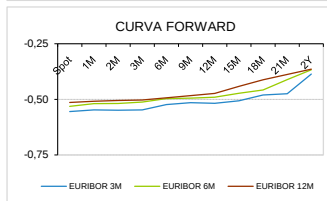
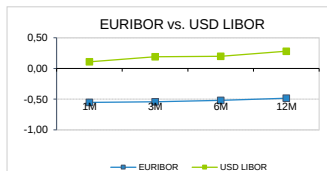
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

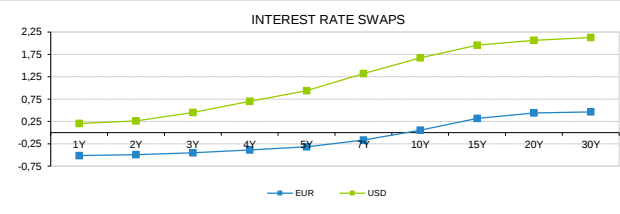
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5530	1	0	1M	0,1081	0	0	0,0501	-0,8022
3M	-0,5430	0	0	3M	0,1900	1	0	0,0780	-0,7558
6M	-0,5200	0	0	6M	0,1979	0	0	0,1011	-0,7116
12M	-0,4850	1	1	12M	0,2808	0	-2	0,1566	-0,5910

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5131	0	1	-0,4732	-0,2126	0,1340
2Y	-0,4935	1	1	-0,4184	-0,1265	0,2130
3Y	-0,4502	1	3	-0,3493	-0,0393	0,2887
4Y	-0,3898	2	4	-0,2715	0,0442	0,3607
5Y	-0,3190	3	5	-0,1898	0,1211	0,4252
7Y	-0,1655	4	7	-0,0320	0,2663	0,5300
10Y	0,0535	5	9	0,1778	0,4320	0,6370
15Y	0,3160	5	11	0,4044	0,5707	0,6975
20Y	0,4388	5	11	0,4939	0,5994	0,6735
30Y	0,4628	5	11	0,4897	0,5446	0,5791

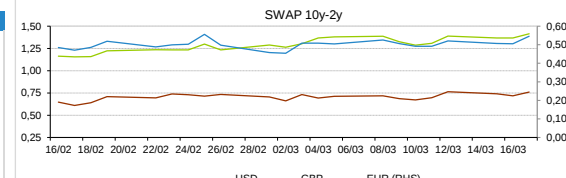
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2040	0	3	0,3224	1,4410	2,2140
2Y	0,2615	1	6	0,5754	1,6665	2,2565
3Y	0,4487	1	14	0,8677	1,8440	2,3775
4Y	0,7010	2	22	1,0925	2,0062	2,4452
5Y	0,9365	3	26	1,3220	2,0510	2,4813
7Y	1,3219	4	31	1,6110	2,1805	2,4535
10Y	1,6720	5	31	1,9204	2,3409	2,4765
15Y	1,9560	5	31	2,1010	2,3860	2,5020
20Y	2,0655	5	29	2,1680	2,3976	2,4195
30Y	2,1272	5	28	2,1445	2,3280	2,3110

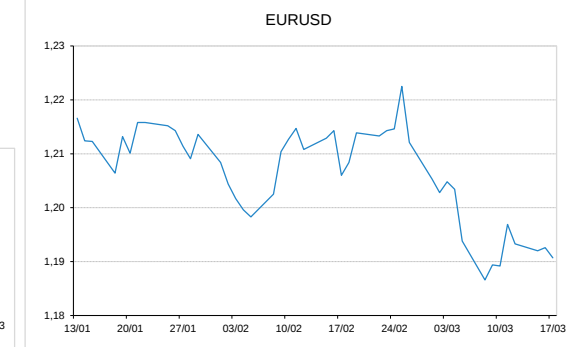
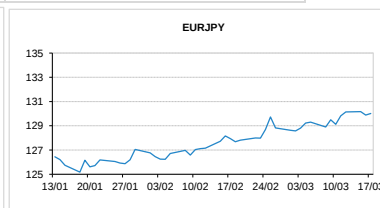
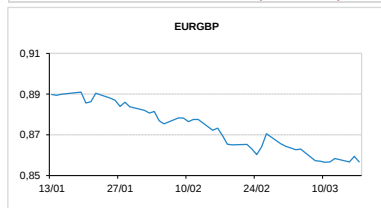


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	67,45	-0,94	3,85	OT 2Y	-0,580	0,02	0,30
JETFUEL	555,25	-5,75	19,50	OT 5Y	-0,227	0,04	4,70
DIESEL	541,75	-5,50	20,50	OT 10Y	0,258	0,06	10,60
COBRE	8 923,50	-184,00	555,00	BUND 10Y	-0,800	4,77	8,60
ZINCO	2 798,25	-49,00	-24,75	SCHATZ 2Y	-0,041	0,46	1,80
OURO	1 727,64	-1,53	-48,27	T-NOTE 10Y	2,419	3,00	36,70
TRIGO	643,75	-3,25	-4,25	T-NOTE 2Y	0,763	0,19	4,80
LICENÇA C02	42,83	1,23	4,74	GILT 10Y	1,077	4,22	24,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1907	-0,16%	-1,27%	1,1931	1,1955	1,2008
EUR/GBP	0,85668	0,32%	1,51%	0,8581	0,8596	0,8628
EUR/JPY	130,02	-0,11%	-1,60%	130,02	130,02	130,02
EUR/CHF	1,1046	-0,35%	-2,05%	1,1039	1,1032	1,1020
EUR/BRL	6,7211	-0,36%	-2,97%	6,7681	6,8383	7,0315
EUR/PLN	4,6076	-0,26%	-2,55%	4,6139	4,6208	4,6398



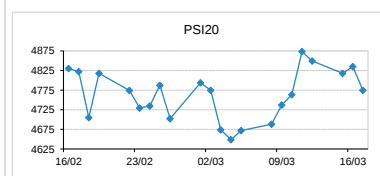
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1907	0,8567	130,02	1,1046	10,1411	7,4358	1,4856	1,54463	6,7211	10,1217
USD	0,8398	-	0,7204	109,225	0,9287	8,5131	6,2444	1,2485	1,2963	5,6477	8,5053

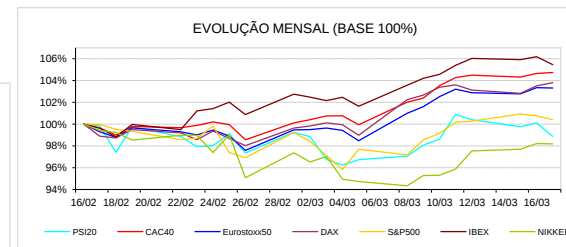
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,860	-1,51	13,57
BCP	0,115	0,00	-6,98
CORT. AMORIM	10,240	-3,40	-11,72
CTT	2,875	-1,54	22,34
EDP	4,781	-1,16	-7,27
EDP R	17,280	-3,89	-24,21
GALP	10,340	-0,86	18,12
IBERSOL	5,780	-0,34	7,04
J MARTINS	13,120	-1,61	-5,07
MOTA ENGIL	1,472	-0,41	7,92
NAVIGATOR	2,742	-1,01	9,77
NOVABASE	3,520	-0,56	9,66
NOS	3,062	-0,13	7,14
PHAROL	0,116	-2,35	-6,89
REN	2,340	-0,43	-1,06
SEMAPA	11,820	-0,67	31,33
SONAE SGPS	0,717	0,00	8,39

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	-1,54
J MARTINS	-1,61
PHAROL	-2,35
CORT. AMORIM	-3,40
EDP R	-3,89



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4 769,73	-1,35%	-2,63%	5 317,89	3 500,02
CAC40	6 054,82	-0,01%	9,07%	6 089,20	3 691,08
ESTX 50 PR	3 849,74	-0,03%	8,36%	3 857,07	2 345,30
XTRA DAX	14 596,61	0,27%	6,40%	14 601,79	8 257,53
S&P 500	3 942,45	-0,51%	4,96%	3 981,04	2 191,86
IBEX 35	8 599,50	-0,67%	6,51%	8 740,10	6 083,00
NIKKEI 225	29 914,33	-0,02%	9,00%	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.