

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

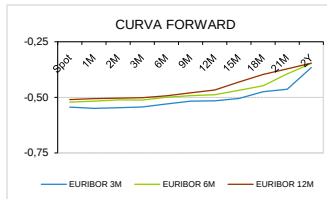
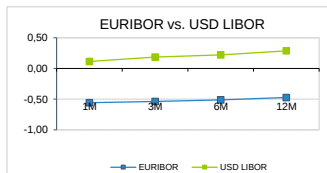
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

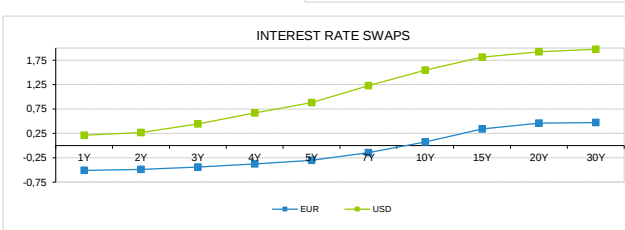
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5580	-1	-1	1M	0,1138	0	1	0,0469	-0,7996
3M	-0,5380	0	0	3M	0,1860	0	-1	0,0841	-0,7494
6M	-0,5130	0	0	6M	0,2218	0	2	0,1121	-0,7050
12M	-0,4730	1	1	12M	0,2868	-1	1	0,1581	-0,5910

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5093	0	1	-0,4675	-0,1790	0,1640
2Y	-0,4885	0	2	-0,4078	-0,0927	0,2379
3Y	-0,4417	-1	2	-0,3322	-0,0090	0,3130
4Y	-0,3760	-1	3	-0,2512	0,0710	0,3850
5Y	-0,3017	-2	3	-0,1670	0,1515	0,4467
7Y	-0,1455	-2	3	-0,0089	0,2910	0,5540
10Y	0,0730	-3	2	0,2023	0,4600	0,6640
15Y	0,3398	-3	2	0,4340	0,6020	0,7186
20Y	0,4584	-3	1	0,5182	0,6250	0,6892
30Y	0,4714	-3	-1	0,4989	0,5510	0,5818

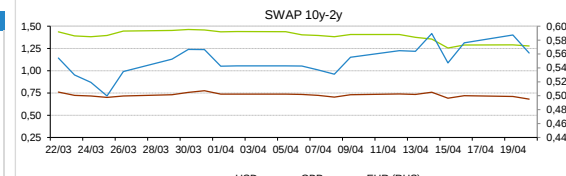
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,75
Austrália	0,10
Índia	3,50



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2123	0	0	0,3242	1,3340	2,0430
2Y	0,2679	-1	0	0,5538	1,5360	2,1334
3Y	0,4429	-1	0	0,8070	1,6990	2,1825
4Y	0,6690	-2	-4	1,0350	1,8340	2,2381
5Y	0,8800	-2	-8	1,2300	1,9255	2,2721
7Y	1,2291	-2	-12	1,5258	2,0330	2,2945
10Y	1,5462	-2	-15	1,7510	2,1587	2,3260
15Y	1,8139	-2	-16	1,9470	2,2070	2,3160
20Y	1,9230	-2	-16	2,0110	2,2246	2,2790
30Y	1,9741	-2	-16	2,0295	2,1611	2,1845

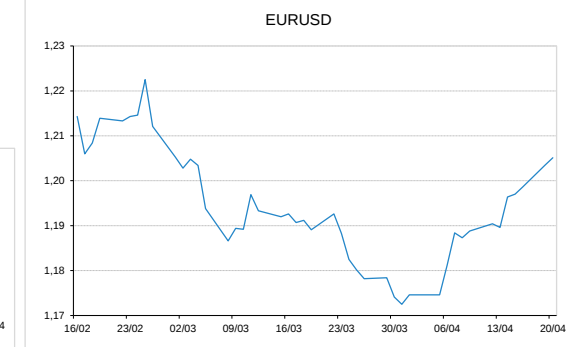
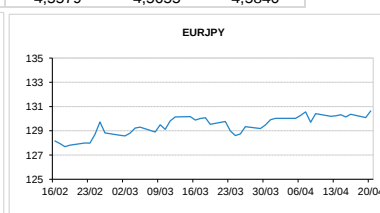


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	66,06	-0,99	1,71	OT 2Y	-0,553	0,01	4,60
JETFUEL	552,49	-0,76	20,99	OT 5Y	-0,240	0,00	2,90
DIESEL	534,25	-1,00	16,00	OT 10Y	0,405	-0,01	17,40
COBRE	9.322,00	165,00	319,00	BUND 10Y	-0,780	-2,22	2,90
ZINCO	2.833,25	-10,50	0,25	SCHATZ 2Y	-0,046	-1,15	0,90
OURO	1.779,44	7,93	34,21	T-NOTE 10Y	2,331	-3,13	-12,80
TRIGO	669,75	16,00	50,50	T-NOTE 2Y	0,756	-0,93	-0,70
LICENÇA C02	44,90	0,55	2,93	GILT 10Y	0,965	-2,82	-12,20



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2051	0,13%	1,05%	1,2074	1,2098	1,2151
EUR/GBP	0,86295	0,07%	-0,07%	0,8644	0,8658	0,8690
EUR/JPY	130,64	-0,42%	-0,67%	130,64	130,64	130,64
EUR/CHF	1,1012	0,04%	0,12%	1,1006	1,1000	1,0988
EUR/BRL	6,6418	0,56%	-1,11%	6,7026	6,7814	6,9747
EUR/PLN	4,5518	0,05%	0,91%	4,5579	4,5655	4,5840



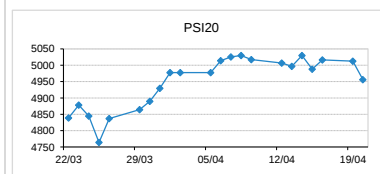
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2051	0,8630	130,64	1,1012	10,1511	7,4363	1,5146	1,55635	6,6418	10,0467
USD	0,8300	-	0,7168	108,125	0,9140	8,4195	6,1719	1,2554	1,2904	5,5093	8,3266

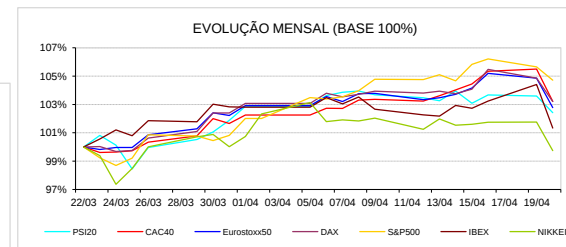
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,330	-2,01	22,67
BCP	0,114	-1,47	-7,22
CORT. AMORIM	10,120	-0,39	-12,76
CTT	3,545	1,29	50,85
EDP	4,979	-1,05	-3,43
EDP R	19,720	0,36	-13,51
GALP	9,298	-3,61	6,21
IBERSOL	6,060	0,33	12,22
J MARTINS	14,280	-1,21	3,33
MOTA ENGIL	1,404	-2,36	2,93
NAVIGATOR	2,790	-1,55	11,69
NOVABASE	3,980	-1,73	23,99
NOS	3,002	-1,25	5,04
PHAROL	0,105	-3,32	-16,03
REN	2,410	-0,41	1,90
SEMAPA	12,080	-0,17	34,22
SONAE SGPS	0,791	-1,31	19,50

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	1,29
EDP R	0,36
IBERSOL	0,33
NOVABASE	-1,73
ALTRI	-2,01
MOTA ENGIL	-2,36
PHAROL	-3,32
GALP	-3,61



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.956,12	-1,13%	1,18%	5.317,89	3.820,68
CAC40	6.160,35	-2,17%	10,97%	6.319,08	4.194,58
ESTX 50 PR	3.940,15	-1,98%	10,91%	4.040,88	2.708,07
XTRA DAX	15.126,74	-1,57%	10,26%	15.501,84	10.160,89
S&P 500	4.126,58	-0,89%	9,86%	4.191,31	2.727,10
IBEX 35	8.454,90	-2,94%	4,72%	8.741,40	6.329,50
NIKKEI 225	29.100,38	-1,97%	6,03%	30.714,52	18.858,25



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.