

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

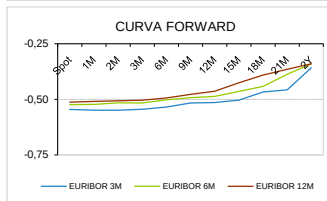
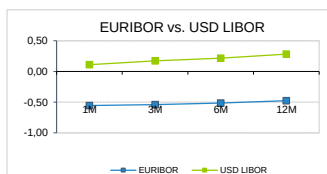
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

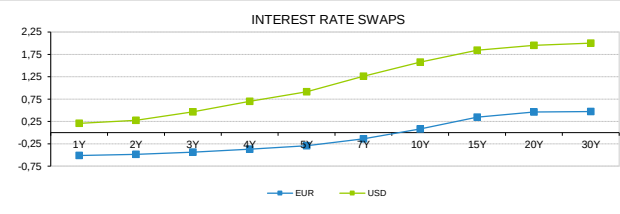
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5550	0	-1	1M	0,1103	0	0	0,0480	-0,7988
3M	-0,5390	0	0	3M	0,1729	-1	-2	0,0871	-0,7454
6M	-0,5150	0	0	6M	0,2165	-1	1	0,1101	-0,7050
12M	-0,4760	0	2	12M	0,2823	0	1	0,1579	-0,5914

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5119	0	1	-0,4633	-0,1689	0,1740
2Y	-0,4875	0	2	-0,4005	-0,0804	0,2510
3Y	-0,4390	0	3	-0,3240	0,0037	0,3245
4Y	-0,3710	1	3	-0,2417	0,0850	0,4025
5Y	-0,2943	1	4	-0,1570	0,1620	0,4595
7Y	-0,1385	1	4	0,0010	0,3049	0,5690
10Y	0,0825	1	3	0,2112	0,4670	0,6704
15Y	0,3458	1	2	0,4392	0,6070	0,7220
20Y	0,4618	0	1	0,5220	0,6260	0,6900
30Y	0,4708	0	-1	0,4989	0,5504	0,5789

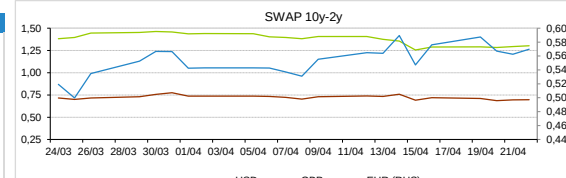
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,75
Austrália	0,10
Índia	3,50



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2066	0	0	0,3367	1,3765	2,0803
2Y	0,2730	0	1	0,5929	1,6039	2,0930
3Y	0,4629	1	2	0,8624	1,7567	2,1900
4Y	0,6969	1	-1	1,0898	1,8430	2,2681
5Y	0,9101	1	-5	1,2815	1,9716	2,3021
7Y	1,2565	1	-10	1,5620	2,0894	2,3175
10Y	1,5731	1	-13	1,8046	2,1899	2,3475
15Y	1,8397	0	-14	1,9953	2,2554	2,3425
20Y	1,9492	0	-13	2,0450	2,2531	2,2600
30Y	2,0004	0	-13	2,0075	2,1915	2,1450

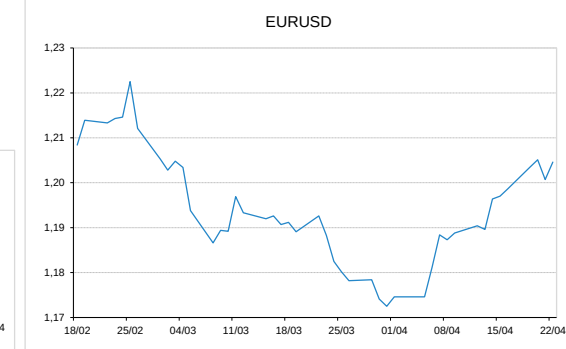
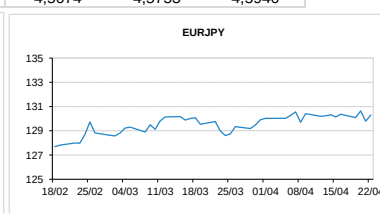


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	65,51	0,19	0,99	OT 2Y	-0,545	0,01	1,70
JETFUEL	537,92	-9,83	6,42	OT 5Y	-0,246	0,00	-2,60
DIESEL	519,92	-9,58	1,67	OT 10Y	0,399	0,00	13,90
COBRE	9.450,00	123,00	388,00	BUND 10Y	-0,781	0,49	1,30
ZINCO	2.802,00	1,50	-31,00	SCHATZ 2Y	-0,044	0,46	-0,50
OURO	1.782,89	-8,00	42,23	T-NOTE 10Y	2,352	1,79	-2,50
TRIGO	698,75	23,75	79,50	T-NOTE 2Y	0,759	0,74	2,60
LICENÇA C02	46,89	0,98	4,05	GILT 10Y	0,980	-0,27	-8,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2046	0,32%	1,01%	1,2069	1,2093	1,2146
EUR/GBP	0,86855	-0,70%	-0,72%	0,8700	0,8715	0,8746
EUR/JPY	130,3	-0,38%	-0,41%	130,30	130,30	130,30
EUR/CHF	1,1030	-0,02%	-0,07%	1,1024	1,1018	1,1006
EUR/BRL	6,5992	1,50%	-0,55%	6,6585	6,7366	6,9250
EUR/PLN	4,5614	-0,04%	0,74%	4,5674	4,5753	4,5940



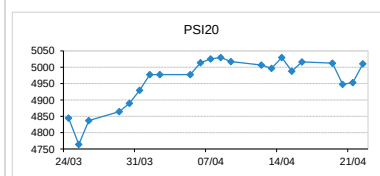
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2046	0,8686	130,30	1,1030	10,1312	7,4363	1,5006	1,5552	6,5992	10,0352
USD	0,8318	-	0,7222	108,005	0,9172	8,4260	6,1852	1,2502	1,2939	5,4937	8,3484

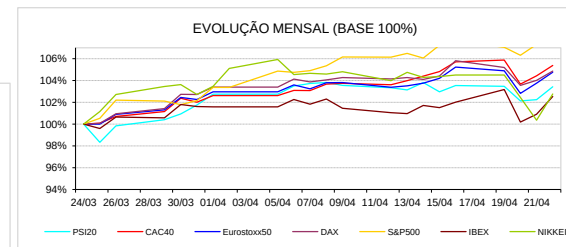
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,490	0,85	25,78
BCP	0,113	0,62	-7,95
CORT. AMORIM	9,860	-0,60	-15,00
CTT	3,625	0,97	54,26
EDP	4,938	4,20	-4,23
EDP R	20,780	7,06	-8,86
GALP	9,406	-0,30	7,45
IBERSOL	6,020	-1,31	11,48
J MARTINS	14,445	0,31	4,52
MOTA ENGIL	1,422	-0,14	4,25
NAVIGATOR	2,800	0,07	12,09
NOVABASE	3,900	-2,01	21,50
NOS	3,090	2,18	8,12
PHAROL	0,104	0,97	-16,51
REN	2,435	0,62	2,96
SEMAPA	12,020	-0,50	33,56
SONAE SGPS	0,783	-0,70	18,37

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
EDP R	7,06
EDP	4,20
NOS	2,18
CTT	0,97
PHAROL	0,97
SEMAPA	-0,50
CORT. AMORIM	-0,60
SONAE SGPS	-0,70
IBERSOL	-1,31
NOVABASE	-2,01



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.010,65	1,16%	2,29%	5.317,89	3.820,68
CAC40	6.267,28	0,91%	12,90%	6.319,08	4.194,58
ESTX 50 PR	4.014,80	0,97%	13,01%	4.040,88	2.708,07
XTRA DAX	15.320,52	0,82%	11,68%	15.501,84	10.160,89
S&P 500	4.173,06	0,06%	11,18%	4.191,31	2.766,64
IBEX 35	8.656,80	1,54%	7,15%	8.741,40	6.329,50
NIKKEI 225	29.188,17	2,38%	6,35%	30.714,52	19.175,38



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.