

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

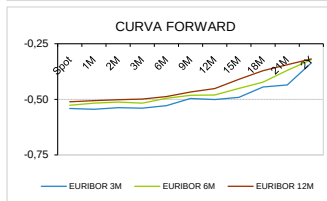
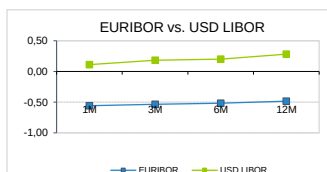
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

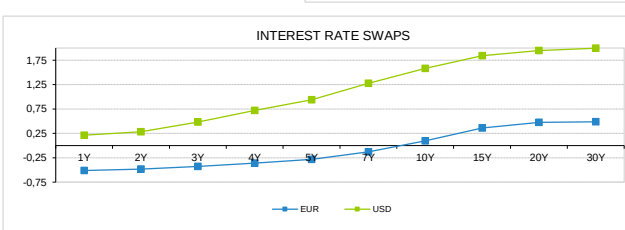
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5580	0	-1	1M	0,1110	0	0	0,0449	-0,7972
3M	-0,5350	0	0	3M	0,1840	0	-2	0,0875	-0,7456
6M	-0,5180	0	0	6M	0,2019	0	0	0,1110	-0,7064
12M	-0,4840	-1	1	12M	0,2820	0	0	0,1595	-0,5920

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5115	0	1	-0,4511	-0,1550	0,1870
2Y	-0,4810	0	3	-0,3840	-0,0690	0,2654
3Y	-0,4275	0	4	-0,3081	0,0160	0,3430
4Y	-0,3592	1	5	-0,2280	0,0985	0,4150
5Y	-0,2840	1	5	-0,1430	0,1770	0,4770
7Y	-0,1274	0	5	0,0180	0,3210	0,5850
10Y	0,0950	1	5	0,2270	0,4860	0,6890
15Y	0,3601	1	4	0,4560	0,6250	0,7430
20Y	0,4771	1	3	0,5400	0,6450	0,7110
30Y	0,4870	1	2	0,5200	0,5730	0,6030

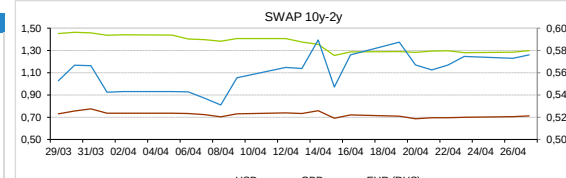
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,75
Austrália	0,10
Índia	3,50



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2130	0	0	0,3538	1,4350	2,0847
2Y	0,2841	0	2	0,6158	1,6250	2,1250
3Y	0,4812	0	2	0,8820	1,7903	2,1950
4Y	0,7200	1	0	1,1010	1,8770	2,2400
5Y	0,9381	1	-3	1,2860	1,9670	2,2922
7Y	1,2763	1	-9	1,5650	2,0750	2,3030
10Y	1,5826	2	-14	1,8130	2,1893	2,3430
15Y	1,8413	2	-16	1,9720	2,2260	2,3370
20Y	1,9477	2	-16	2,0450	2,2473	2,3262
30Y	1,9960	2	-17	2,0265	2,1655	2,2096

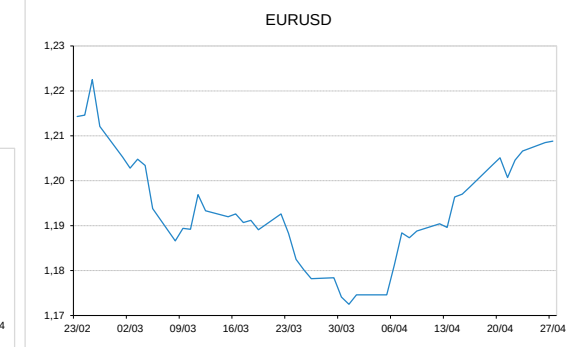
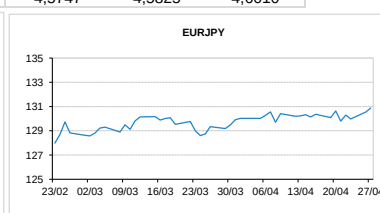


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	65,92	0,27	1,49	OT 2Y	-0,557	-0,01	5,80
JETFUEL	545,50	-0,74	17,74	OT 5Y	-0,239	0,01	8,50
DIESEL	527,00	-1,75	13,25	OT 10Y	0,418	0,01	24,40
COBRE	9.778,00	199,50	789,00	BUND 10Y	-0,776	0,56	9,50
ZINCO	2.904,00	62,50	79,25	SCHATZ 2Y	-0,041	0,23	3,00
OURO	1.779,14	0,27	46,62	T-NOTE 10Y	2,365	1,64	-4,20
TRIGO	744,00	4,50	134,75	T-NOTE 2Y	0,772	0,37	2,60
LICENÇA C02	47,43	0,23	5,70	GILT 10Y	1,009	1,55	1,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2088	0,02%	2,58%	1,2111	1,2135	1,2189
EUR/GBP	0,86895	0,09%	-2,04%	0,8704	0,8719	0,8750
EUR/JPY	130,88	-0,26%	-1,29%	130,88	130,88	130,88
EUR/CHF	1,1033	0,16%	0,09%	1,1027	1,1021	1,1009
EUR/BRL	6,5568	0,09%	3,66%	6,6190	6,6979	6,8894
EUR/PLN	4,5686	-0,25%	2,07%	4,5747	4,5825	4,6010



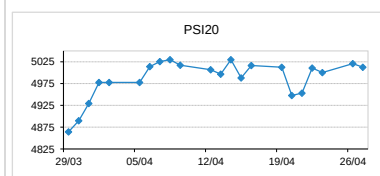
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2088	0,8690	130,88	1,1033	10,1206	7,4360	1,4973	1,55348	6,5568	9,9999
USD	0,8278	-	0,7186	108,475	0,9128	8,3798	6,1553	1,2405	1,2866	5,4410	8,2899

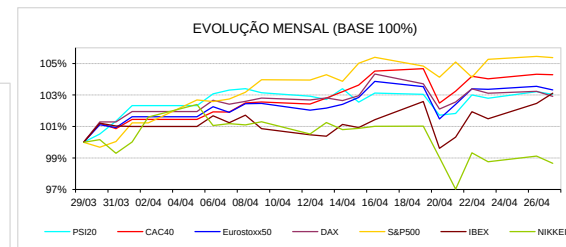
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,625	-0,90	28,39
BCP	0,115	0,00	-6,41
CORT. AMORIM	10,100	1,10	-12,93
CTT	3,660	-2,27	55,74
EDP	4,788	-0,73	-7,14
EDP R	20,720	0,97	-9,12
GALP	9,440	-0,65	7,84
IBERSOL	6,220	0,32	15,19
J MARTINS	14,175	0,04	2,57
MOTA ENGIL	1,414	-0,77	3,67
NAVIGATOR	2,866	-0,21	14,73
NOVABASE	4,060	1,00	26,48
NOS	3,138	-0,06	9,80
PHAROL	0,104	-0,95	-16,83
REN	2,430	-0,41	2,75
SEMAPA	12,100	-0,49	34,44
SONAE SGPS	0,784	-0,06	18,52

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	1,10
NOVABASE	1,00
EDP R	0,97
IBERSOL	0,32
J MARTINS	0,04
EDP	-0,73
MOTA ENGIL	-0,77
ALTRI	-0,90
PHAROL	-0,95
CTT	-2,27



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.012,61	-0,16%	2,33%	5.317,89	3.820,68
CAC40	6.273,76	-0,03%	13,01%	6.319,08	4.194,58
ESTX 50 PR	4.011,91	-0,22%	12,93%	4.040,88	2.708,07
XTRA DAX	15.249,27	-0,31%	11,16%	15.501,84	10.160,89
S&P 500	4.186,99	-0,07%	11,41%	4.194,19	2.766,64
IBEX 35	8.756,70	0,63%	8,46%	8.756,70	6.329,50
NIKKEI 225	28.991,89	-0,46%	5,64%	30.714,52	19.448,93



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.