

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

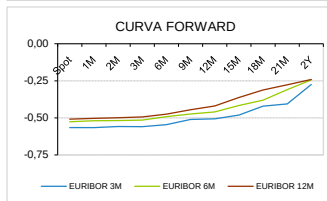
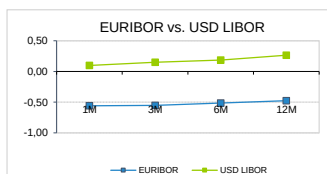
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

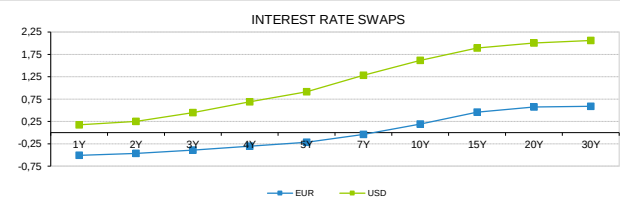
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5590	0	-1	1M	0,0975	0	-2	0,0520	-0,7956
3M	-0,5530	-1	-2	3M	0,1496	-1	-4	0,0859	-0,7460
6M	-0,5150	0	0	6M	0,1865	0	-4	0,1018	-0,7004
12M	-0,4760	0	0	12M	0,2645	0	-3	0,1685	-0,5886

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5085	0	0	-0,4210	-0,0460	0,3111
2Y	-0,4640	0	2	-0,3328	0,0470	0,3898
3Y	-0,3910	0	4	-0,2373	0,1394	0,4661
4Y	-0,3043	1	6	-0,1449	0,2190	0,5368
5Y	-0,2145	1	7	-0,0514	0,2978	0,5967
7Y	-0,0405	2	8	0,1200	0,4394	0,6980
10Y	0,1908	2	9	0,3310	0,5965	0,7971
15Y	0,4568	3	9	0,5562	0,7320	0,8490
20Y	0,5747	3	8	0,6407	0,7531	0,8170
30Y	0,5885	3	8	0,6231	0,6809	0,7093

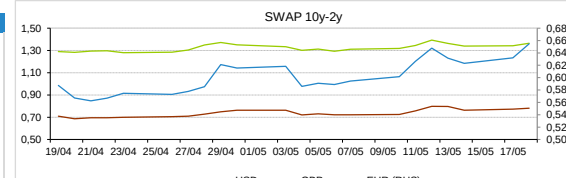
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,50
Austrália	0,10
Índia	3,50



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,1749	0	-4	0,3262	1,4109	2,1260
2Y	0,2519	0	-2	0,5750	1,6296	2,2418
3Y	0,4485	0	-1	0,8480	1,7520	2,2840
4Y	0,6901	1	0	1,0705	1,8785	2,3465
5Y	0,9145	1	1	1,2705	1,9765	2,3822
7Y	1,2808	2	3	1,5595	2,0980	2,3630
10Y	1,6164	2	5	1,8300	2,2380	2,4255
15Y	1,8929	3	6	2,0320	2,3050	2,3830
20Y	2,0058	3	6	2,1020	2,3020	2,3420
30Y	2,0603	3	7	2,0830	2,2500	2,2690

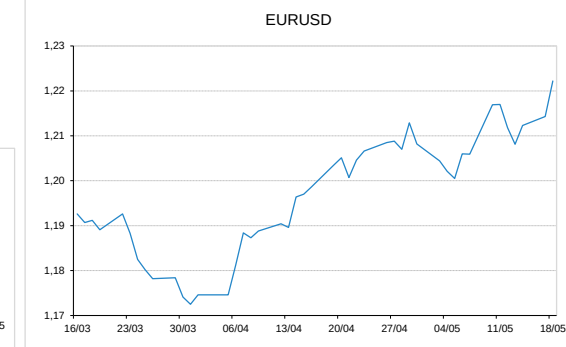
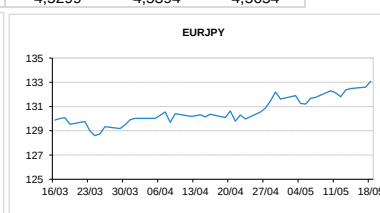


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	69,23	-0,23	2,94	OT 2Y	-0,514	-0,02	4,80
JETFUEL	586,75	6,74	33,50	OT 5Y	-0,137	0,00	11,40
DIESEL	568,50	6,75	33,25	OT 10Y	0,603	-0,02	20,50
COBRE	10.367,00	132,50	1.162,00	BUND 10Y	-0,634	0,99	15,40
ZINCO	3.001,25	75,00	150,50	SCHATZ 2Y	-0,009	0,23	3,50
OURO	1.864,81	-3,30	88,30	T-NOTE 10Y	2,358	0,60	0,90
TRIGO	705,25	5,50	50,25	T-NOTE 2Y	0,750	-0,19	-1,80
LICENÇA C02	52,48	-3,86	8,06	GILT 10Y	1,095	-0,18	9,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2222	0,65%	1,55%	1,2244	1,2267	1,2315
EUR/GBP	0,85998	0,25%	0,42%	0,8614	0,8629	0,8660
EUR/JPY	133,09	-0,37%	-2,25%	133,09	133,09	133,09
EUR/CHF	1,0965	-0,03%	0,45%	1,0958	1,0952	1,0940
EUR/BRL	6,3926	0,36%	4,58%	6,4609	6,5422	6,7550
EUR/PLN	4,5230	0,20%	0,69%	4,5299	4,5394	4,5654



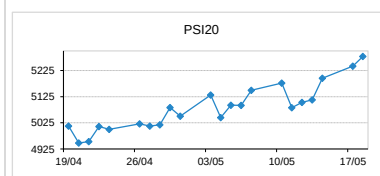
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2222	0,8600	133,09	1,0965	10,1267	7,4362	1,4720	1,56828	6,3926	10,0385
USD	0,8184	-	0,7037	108,885	0,8972	8,2857	6,0861	1,2051	1,2830	5,2640	8,2073

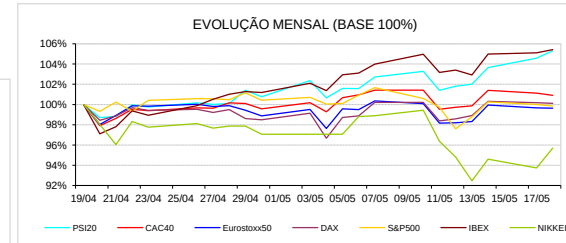
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,450	0,47	25,00
BCP	0,166	3,75	34,90
CORT. AMORIM	10,100	0,40	-12,93
CTT	3,995	3,63	70,00
EDP	4,644	2,04	-9,93
EDP R	18,880	3,74	-17,19
GALP	10,160	1,30	16,06
IBERSOL	5,920	-1,33	9,63
J MARTINS	15,910	-0,13	15,12
MOTA ENGIL	1,442	3,30	5,72
NAVIGATOR	3,222	0,06	28,98
NOVABASE	4,010	1,01	24,92
NOS	3,170	-0,69	10,92
PHAROL	0,105	1,35	-15,71
REN	2,380	0,00	0,63
SEMAPA	11,920	-0,67	32,44
SONAE SGPS	0,797	0,00	20,41

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	3,75
EDP R	3,74
CTT	3,63
MOTA ENGIL	3,30
EDP	2,04
J MARTINS	-0,13
SEMAPA	-0,67
NOS	-0,69
IBERSOL	-1,33



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.278,80	0,70%	7,77%	5.324,81	3.820,68
CAC40	6.353,67	-0,21%	14,45%	6.412,91	4.354,73
ESTX 50 PR	4.005,34	-0,04%	12,74%	4.043,21	2.800,07
XTRA DAX	15.386,58	-0,07%	12,16%	15.538,01	10.677,52
S&P 500	4.158,16	-0,13%	10,70%	4.238,04	2.913,86
IBEX 35	9.183,90	0,31%	13,75%	9.241,50	6.329,50
NIKKEI 225	28.406,84	2,09%	3,51%	30.714,52	20.334,99



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.