

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

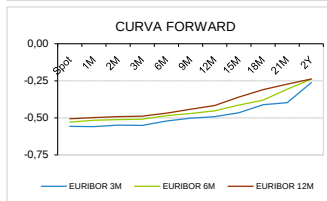
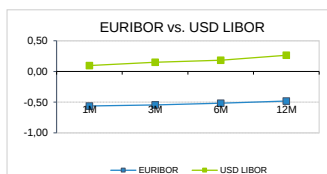
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

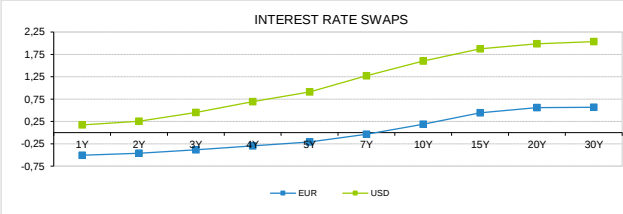
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5620	0	0	1M	0,0965	0	-2	0,0531	-0,7958
3M	-0,5450	1	-1	3M	0,1493	-1	-4	0,0806	-0,7500
6M	-0,5170	0	0	6M	0,1836	0	-4	0,1044	-0,7028
12M	-0,4820	0	-1	12M	0,2635	0	-2	0,1649	-0,5886

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5058	0	0	-0,4161	-0,0380	0,3110
2Y	-0,4607	0	3	-0,3277	0,0548	0,3910
3Y	-0,3863	0	6	-0,2310	0,1390	0,4610
4Y	-0,2983	0	8	-0,1335	0,2210	0,5240
5Y	-0,2090	0	9	-0,0467	0,2949	0,5810
7Y	-0,0388	0	10	0,1185	0,4300	0,6820
10Y	0,1858	0	11	0,3230	0,5830	0,7805
15Y	0,4447	0	10	0,5440	0,7170	0,8260
20Y	0,5586	0	10	0,6240	0,7316	0,7920
30Y	0,5665	-1	9	0,5985	0,6534	0,6810

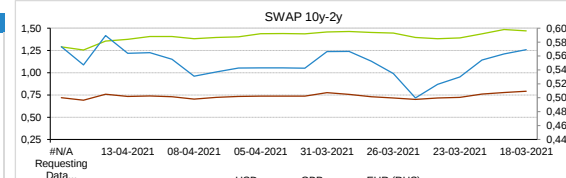
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,50
Austrália	0,10
Índia	3,50



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,1725	0	-4	0,3327	1,3990	2,1155
2Y	0,2523	0	-2	0,5891	1,5990	2,2145
3Y	0,4490	1	0	0,8490	1,7670	2,2675
4Y	0,6914	1	2	1,0991	1,8910	2,3150
5Y	0,9098	1	3	1,2810	1,9915	2,3598
7Y	1,2703	0	4	1,5730	2,1120	2,3810
10Y	1,6012	-1	5	1,8185	2,2370	2,4350
15Y	1,8735	-1	5	2,0312	2,3034	2,4265
20Y	1,9862	-1	5	2,1019	2,2970	2,3863
30Y	2,0350	-1	5	2,0925	2,2295	2,2606

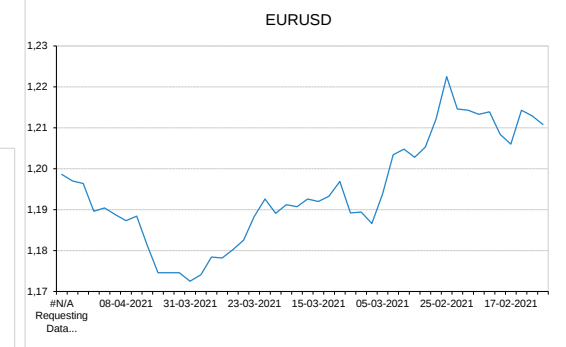
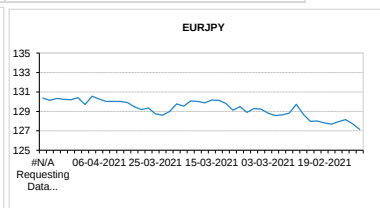
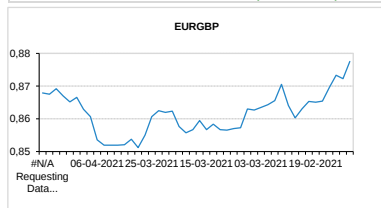


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	66,24	-0,42	0,32	OT 2Y	-0,533	-0,01	1,70
JETFUEL	568,75	-13,76	16,26	OT 5Y	-0,156	-0,03	-2,60
DIESEL	551,75	-13,00	17,50	OT 10Y	0,576	-0,03	13,90
COBRE	10.073,50	-403,50	625,50	BUND 10Y	-0,642	0,49	1,30
ZINCO	2.927,25	-117,00	86,75	SCHATZ 2Y	-0,009	0,46	-0,50
OURO	1.879,62	-2,44	101,60	T-NOTE 10Y	2,352	-2,99	-2,50
TRIGO	678,50	-0,75	17,25	T-NOTE 2Y	0,750	-0,56	2,60
LICENÇA C02	52,45	2,77	7,56	GILT 10Y	1,068	0,00	-8,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2203	-0,07%	1,26%	1,2225	1,2247	1,2295
EUR/GBP	0,864	-0,19%	-0,12%	0,8654	0,8669	0,8699
EUR/JPY	132,95	0,26%	-1,74%	132,95	132,95	132,95
EUR/CHF	1,0984	0,11%	0,33%	1,0978	1,0972	1,0960
EUR/BRL	6,4499	0,25%	3,89%	6,5195	6,6031	6,8169
EUR/PLN	4,4931	0,50%	1,32%	4,4996	4,5088	4,5345



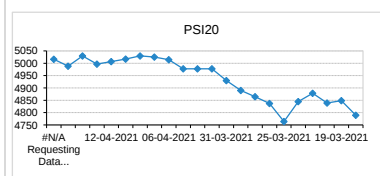
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2203	0,8640	132,95	1,0984	10,1446	7,4362	1,4740	1,57094	6,4499	10,1418
USD	0,8187	-	0,7065	108,845	0,9000	8,3193	6,0879	1,2067	1,2875	5,2934	8,3071

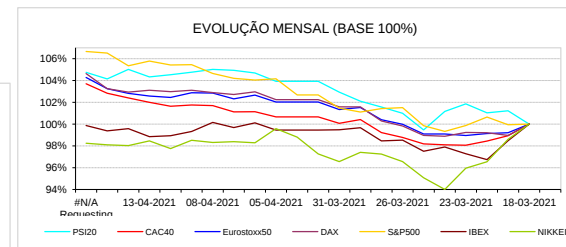
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,440	1,66	24,81
BCP	0,164	-0,43	32,95
CORT. AMORIM	10,100	0,60	-12,93
CTT	4,050	2,40	72,34
EDP	4,725	2,36	-8,36
EDP R	19,350	3,86	-15,13
GALP	9,870	-0,64	12,75
IBERSOL	5,900	0,00	9,26
J MARTINS	15,960	0,85	15,48
MOTA ENGIL	1,488	3,55	9,09
NAVIGATOR	3,212	0,75	28,58
NOVABASE	4,000	0,00	24,61
NOS	3,136	0,19	9,73
PHAROL	0,104	-0,57	-16,35
REN	2,325	0,43	-1,69
SEMAPA	11,680	-2,18	29,78
SONAE SGPS	0,825	3,19	24,64

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP R	3,86
MOTA ENGIL	3,55
SONAE SGPS	3,19
CTT	2,40
EDP	2,36
BCP	-0,43
PHAROL	-0,57
GALP	-0,64
SEMAPA	-2,18



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.279,91	1,15%	7,79%	5.324,81	3.820,68
CAC40	6.337,16	1,19%	14,15%	6.412,91	4.368,80
ESTX 50 PR	3.993,25	1,44%	12,40%	4.043,21	2.854,07
XTRA DAX	15.343,13	1,52%	11,84%	15.538,01	10.867,17
S&P 500	4.156,46	0,98%	10,65%	4.238,04	2.933,59
IBEX 35	9.105,80	0,39%	12,78%	9.241,50	6.329,50
NIKKEI 225	28.098,25	0,19%	2,38%	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.