

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

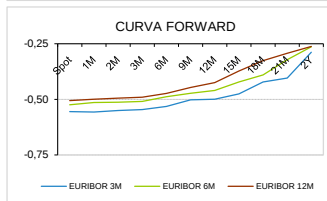
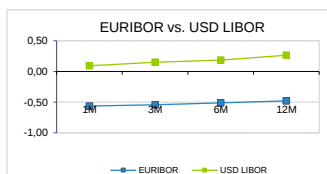
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

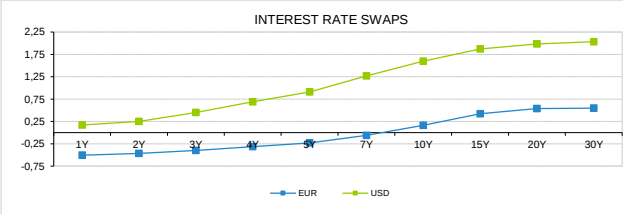
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5630	0	-1	1M	0,0925	0	-2	0,0541	-0,7934
3M	-0,5430	0	-1	3M	0,1501	0	-3	0,0814	-0,7468
6M	-0,5130	0	0	6M	0,1843	0	-4	0,1040	-0,7012
12M	-0,4790	0	0	12M	0,2640	0	-2	0,1645	-0,5874

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,5055	0	1	-0,4245	-0,0708	0,2832	
2Y	-0,4650	-1	2	-0,3435	0,0185	0,3630	
3Y	-0,3970	-1	5	-0,2520	0,1080	0,4340	
4Y	-0,3150	-2	6	-0,1600	0,1901	0,5018	
5Y	-0,2310	-2	7	-0,0738	0,2685	0,5625	
7Y	-0,0615	-2	9	0,0940	0,4060	0,6590	
10Y	0,1640	-2	9	0,3010	0,5605	0,7590	
15Y	0,4230	-2	8	0,5217	0,6925	0,8055	
20Y	0,5372	-2	8	0,6020	0,7085	0,7731	
30Y	0,5470	-2	8	0,5770	0,6330	0,6610	

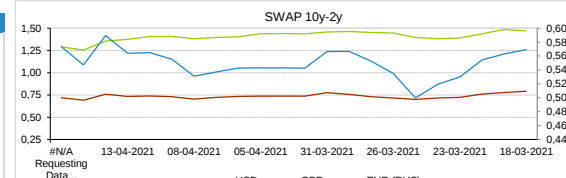
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,50
Austrália	0,10
Índia	3,50



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,1710	0	-4	0,3270	1,4020	2,1232
2Y	0,2505	0	-2	0,5902	1,6040	2,1910
3Y	0,4500	0	-1	0,8465	1,7665	2,2590
4Y	0,6903	0	0	1,0968	1,8890	2,3202
5Y	0,9087	0	1	1,2740	1,9910	2,3538
7Y	1,2679	0	2	1,5845	2,1110	2,3760
10Y	1,5984	0	3	1,8155	2,2353	2,4040
15Y	1,8714	0	4	2,0309	2,2840	2,4236
20Y	1,9840	0	4	2,1025	2,2981	2,3835
30Y	2,0340	0	3	2,0920	2,2297	2,2570

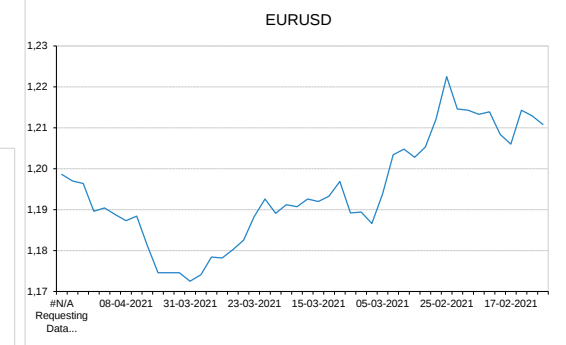
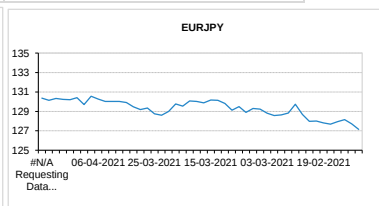
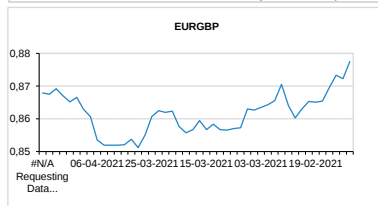


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	66,81	1,70	2,13	OT 2Y	-0,542	-0,01	1,70
JETFUEL	555,25	-13,50	7,50	OT 5Y	-0,178	-0,02	-2,60
DIESEL	539,00	-12,75	9,50	OT 10Y	0,557	-0,02	13,90
COBRE	10.008,00	46,50	726,00	BUND 10Y	-0,663	-2,04	1,30
ZINCO	2.947,75	20,50	139,75	SCHATZ 2Y	-0,016	-0,69	-0,50
OURO	1.876,49	-6,16	85,59	T-NOTE 10Y	2,340	0,15	-2,50
TRIGO	672,25	-3,00	-2,75	T-NOTE 2Y	0,748	0,19	2,60
LICENÇA C02	51,49	-1,21	5,58	GILT 10Y	1,060	-0,92	-8,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2188	-0,12%	1,51%	1,2210	1,2232	1,2280
EUR/GBP	0,8587	0,62%	0,44%	0,8601	0,8616	0,8647
EUR/JPY	132,61	0,26%	-2,12%	132,61	132,61	132,61
EUR/CHF	1,0942	0,36%	0,81%	1,0936	1,0930	1,0917
EUR/BRL	6,4806	-0,27%	3,44%	6,5507	6,6364	6,8523
EUR/PLN	4,4939	-0,03%	1,41%	4,5003	4,5094	4,5353



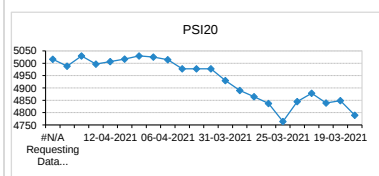
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2188	0,8587	132,61	1,0942	10,1309	7,4362	1,4679	1,57489	6,4806	10,2183
USD	0,8205	-	0,7061	108,97	0,8984	8,3166	6,1015	1,2050	1,2928	5,3128	8,3859

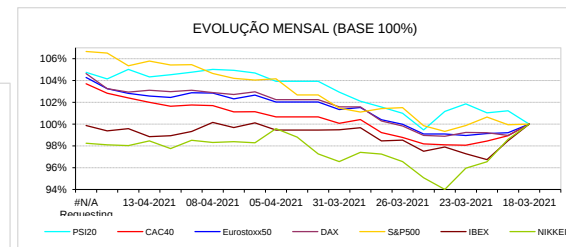
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,270	-2,87	21,51
BCP	0,165	0,86	33,93
CORT. AMORIM	10,080	-0,20	-13,10
CTT	4,025	-0,86	71,28
EDP	4,742	0,47	-8,03
EDP R	19,590	1,29	-14,08
GALP	9,954	0,85	13,71
IBERSOL	6,080	2,36	12,59
J MARTINS	15,785	-1,00	14,22
MOTA ENGIL	1,498	0,67	9,82
NAVIGATOR	3,074	0,20	23,06
NOVABASE	4,100	2,50	27,73
NOS	3,116	-0,70	9,03
PHAROL	0,104	-0,38	-16,67
REN	2,315	-0,64	-2,11
SEMAPA	11,660	-0,17	29,56
SONAE SGPS	0,827	0,12	25,02

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOVABASE	2,50
IBERSOL	2,36
EDP R	1,29
BCP	0,86
GALP	0,85
REN	-0,64
NOS	-0,70
CTT	-0,86
J MARTINS	-1,00
ALTRI	-2,87



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.270,69	-0,18%	7,60%	5.324,81	3.820,68
CAC40	6.389,83	0,73%	15,10%	6.412,91	4.368,80
ESTX 50 PR	4.025,43	0,64%	13,31%	4.043,21	2.854,07
XTRA DAX	15.437,70	0,44%	12,53%	15.538,01	10.867,17
S&P 500	4.170,49	0,26%	11,02%	4.238,04	2.933,59
IBEX 35	9.201,40	0,84%	13,97%	9.241,50	6.329,50
NIKKEI 225	28.317,83	0,78%	3,18%	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.