

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

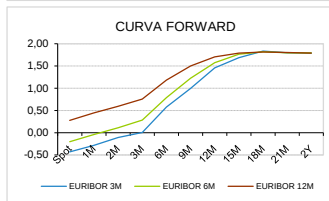
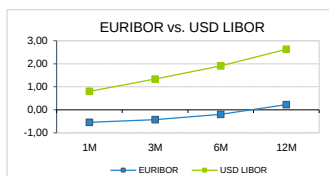
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

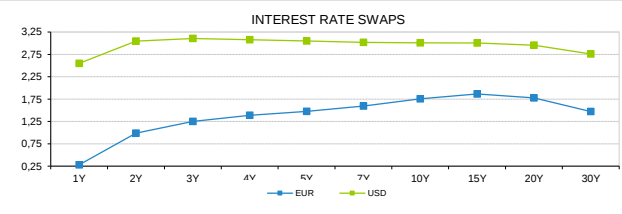
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP	CHF
1M	-0,5430	-2	0	1M	0,8033	0	35	0,9300	-0,6250
3M	-0,4250	-1	4	3M	1,3349	5	33	1,1112	-0,5275
6M	-0,1980	1	16	6M	1,9107	6	41	1,4150	-0,4500
12M	0,2250	1	31	12M	2,6286	8	43	1,8319	-0,7000

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2800	1	36	1,7030	1,8140	1,8650
2Y	0,9887	3	44	1,7470	1,8280	1,9075
3Y	1,2507	2	43	1,7690	1,8410	1,9580
4Y	1,3881	2	46	1,7860	1,8660	2,0100
5Y	1,4760	2	49	1,8010	1,9050	2,0585
7Y	1,5950	1	54	1,8570	1,9900	2,1020
10Y	1,7544	-1	59	1,9590	2,0470	2,0860
15Y	1,8652	-3	60	1,9790	1,9625	1,8940
20Y	1,7764	-4	56	1,8330	1,7630	1,6645
30Y	1,4730	-6	47	1,5000	1,4275	1,3440

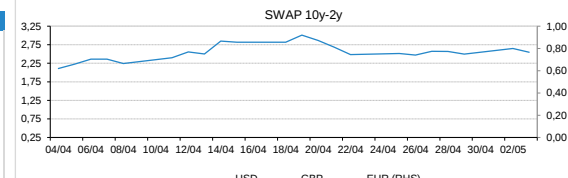
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,00
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	11,75
Austrália	0,35
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5485	0	55	3,4932	2,9770	2,8890
2Y	3,0470	-1	41	3,3616	2,9005	2,9020
3Y	3,1056	-3	37	3,2410	2,9160	2,9190
4Y	3,0788	-5	40	3,1530	2,9220	2,9445
5Y	3,0486	-5	45	3,1050	2,9110	2,9580
7Y	3,0199	-6	51	3,0510	2,9245	2,9200
10Y	3,0063	-6	56	3,0360	2,9696	2,9175
15Y	3,0030	-5	59	2,9990	2,9250	2,8610
20Y	2,9543	-5	57	2,9255	2,8497	2,7630
30Y	2,7585	-4	52	2,7125	2,6007	2,5606

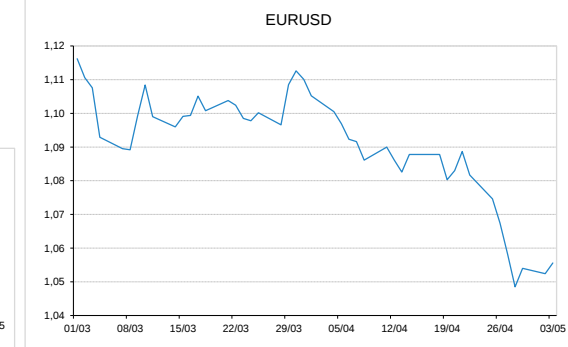
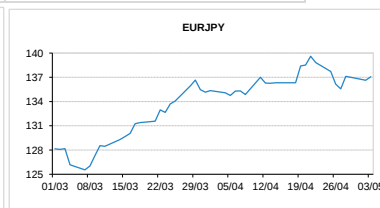
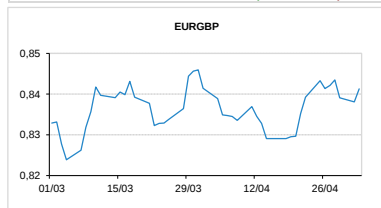


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	105,84	-1,74	3,02	OT 2Y	0,415	-0,03	48,10
JETFUEL	1.353,39	20,14	216,76	OT 5Y	1,359	0,01	70,00
DIESEL	1.259,89	33,64	189,25	OT 10Y	2,058	0,00	67,90
COBRE	9.714,00	72,50	-547,00	BUND 10Y	0,500	-0,24	37,50
ZINCO	4.141,25	-35,25	107,25	SCHATZ 2Y	0,845	1,88	25,30
OURO	1.873,01	9,99	-52,67	T-NOTE 10Y	3,731	-4,94	36,80
TRIGO	1.046,25	-9,25	62,00	T-NOTE 2Y	3,202	-0,79	15,30
LICENÇA C02	88,34	5,30	9,85	GILT 10Y	1,998	3,82	31,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0556	0,30%	-4,08%	1,0607	1,0677	1,0825
EUR/GBP	0,8413	-0,38%	-0,29%	0,8451	0,8497	0,8581
EUR/JPY	137,06	-0,31%	-1,44%	137,06	137,06	137,06
EUR/CHF	1,0306	-0,29%	-1,37%	1,0302	1,0293	1,0276
EUR/BRL	5,2769	1,29%	-4,46%	5,4533	5,6238	5,9484
EUR/PLN	4,6907	0,07%	-1,42%	4,7725	4,8651	5,0348



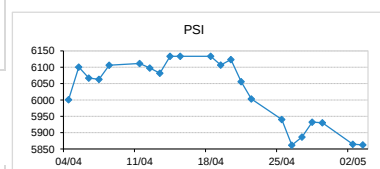
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0556	0,8413	137,06	1,0306	10,3799	7,4403	1,3534	1,48448	5,2769	9,8947
USD	0,9489	-	0,7994	129,925	0,9780	9,8626	7,0606	1,2853	1,4089	5,0095	9,3944

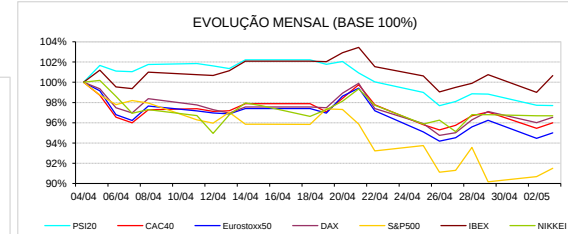
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,450	0,86	14,97
BCP	0,149	2,48	5,75
CORT. AMORIM	9,900	1,12	-12,23
CTT	4,270	-1,73	-6,26
EDP	4,365	0,32	-9,66
EDP R	21,380	-1,61	-2,37
GALP	11,165	-1,19	31,04
J MARTINS	20,020	0,65	-0,40
MOTA ENGIL	1,274	0,00	-0,16
NAVIGATOR	3,944	0,41	17,73
NOS	4,056	-0,69	18,94
REN	2,860	0,18	12,38
SEMAPA	13,120	-0,15	12,14
SONAE SGPS	1,038	-0,48	3,49
GREENVOLT	6,850	0,29	7,87

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	2,48
CORT. AMORIM	1,12
ALTRI	0,86
J MARTINS	0,65
NAVIGATOR	0,41
SONAE SGPS	-0,48
NOS	-0,69
GALP	-1,19
EDP R	-1,61
CTT	-1,73



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI	5.862,67	-0,03%	5,26%	6.153,32	4.859,53
CAC40	6.462,18	0,57%	-9,66%	7.384,86	5.756,38
ESTX 50 PR	3.753,66	0,57%	-12,67%	4.415,23	3.387,00
XTRA DAX	14.015,09	0,55%	-11,77%	16.290,19	12.438,85
S&P 500	4.193,59	0,90%	-12,03%	4.818,62	4.056,88
IBEX 35	8.577,20	1,67%	-1,57%	9.310,80	7.287,70
NIKKEI 225	26.818,53	-0,11%	-6,85%	30.795,78	24.681,74



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.