

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

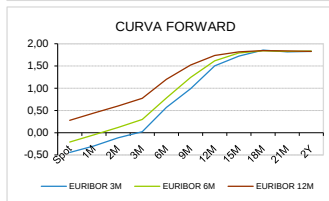
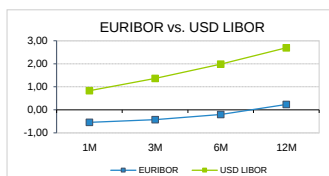
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

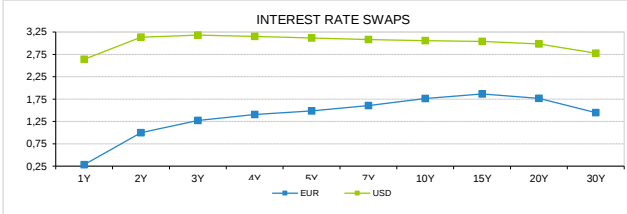
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP	CHF
1M	-0,5440	0	1	1M	0,8317	3	39	0,9731	-0,6250
3M	-0,4270	0	2	3M	1,3633	3	40	1,1630	-0,5250
6M	-0,2050	-1	15	6M	1,9809	7	49	1,4872	-0,5150
12M	0,2340	1	32	12M	2,6949	7	52	1,9255	-0,7000

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2830	0	37	1,7340	1,8138	1,8710
2Y	0,9991	-1	45	1,7790	1,8229	1,9150
3Y	1,2712	0	45	1,7900	1,8413	1,9672
4Y	1,4035	0	47	1,7978	1,8692	2,0155
5Y	1,4855	0	50	1,8130	1,9090	2,0590
7Y	1,6047	0	55	1,8685	1,9890	2,1010
10Y	1,7615	0	60	1,9660	2,0415	2,0800
15Y	1,8647	0	60	1,9770	1,9490	1,8780
20Y	1,7660	-5	55	1,8220	1,7410	1,6400
30Y	1,4485	-2	44	1,4720	1,3900	1,3050

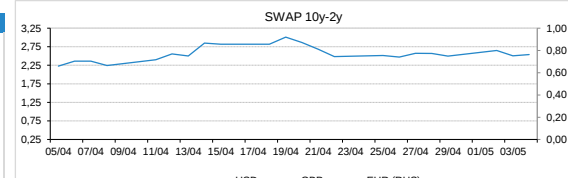
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,00
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	11,75
Austrália	0,35
Índia	4,50



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6396	6	64	3,5970	3,0340	2,9375
2Y	3,1351	4	50	3,4324	2,9910	2,9530
3Y	3,1811	2	45	3,3071	2,9730	2,9500
4Y	3,1511	1	47	3,2227	2,9730	2,9781
5Y	3,1177	0	52	3,1680	2,9942	2,9869
7Y	3,0808	0	58	3,1243	2,9950	2,9760
10Y	3,0568	0	61	3,0800	2,9955	2,9680
15Y	3,0400	0	63	3,0502	2,9470	2,9191
20Y	2,9834	0	60	2,9729	2,8627	2,7904
30Y	2,7755	0	54	2,7410	2,6366	2,5641

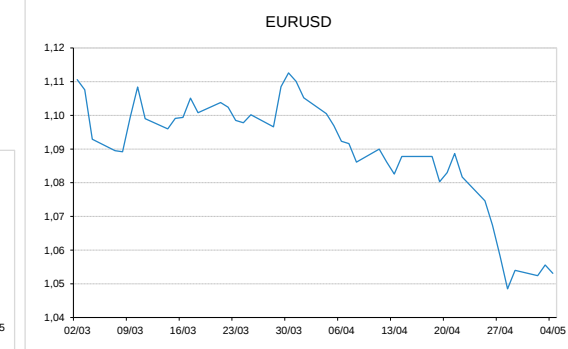
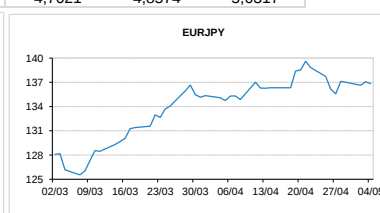


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	108,19	3,22	2,19	OT 2Y	0,459	0,04	50,60
JETFUEL	1.263,00	-90,39	126,37	OT 5Y	1,414	0,04	77,40
DIESEL	1.164,50	-95,39	93,86	OT 10Y	2,109	0,04	75,40
COBRE	9.454,00	-359,50	-943,50	BUND 10Y	0,525	3,72	45,70
ZINCO	3.983,75	-157,50	-392,25	SCHATZ 2Y	0,869	3,29	29,80
OURO	1.866,35	-1,77	-66,38	T-NOTE 10Y	3,770	0,85	39,20
TRIGO	1.073,75	28,25	63,75	T-NOTE 2Y	3,283	3,54	23,80
LICENÇA C02	88,11	-0,08	9,61	GILT 10Y	2,014	1,61	39,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0531	-0,24%	-4,31%	1,0584	1,0654	1,0812
EUR/GBP	0,84194	-0,08%	-0,36%	0,8458	0,8502	0,8590
EUR/JPY	136,84	0,16%	-1,29%	136,84	136,84	136,84
EUR/CHF	1,0367	-0,68%	-1,96%	1,0362	1,0354	1,0336
EUR/BRL	5,2752	-1,10%	-4,47%	5,4508	5,6194	5,9507
EUR/PLN	4,6760	0,34%	-1,12%	4,7621	4,8574	5,0317



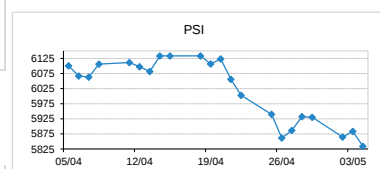
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0531	0,8419	136,84	1,0367	10,3966	7,4408	1,3528	1,47666	5,2752	9,9161
USD	0,9481	-	0,8	129,975	0,9827	9,8668	7,0541	1,2835	1,4014	5,0147	9,4114

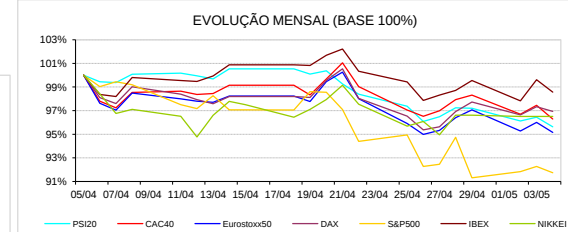
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,530	1,08	16,40
BCP	0,146	-1,81	3,83
CORT. AMORIM	10,460	6,63	-7,27
CTT	4,260	-0,23	-6,48
EDP	4,330	-1,50	-10,39
EDP R	21,300	-1,34	-2,74
GALP	11,005	-1,78	29,17
J MARTINS	19,880	-1,19	-1,09
MOTA ENGIL	1,262	-0,79	-1,10
NAVIGATOR	3,906	-1,11	16,60
NOS	4,094	0,99	20,06
REN	2,860	-0,52	12,38
SEMAPA	13,060	-0,76	11,62
SONAE SGPS	1,028	-1,25	2,49
GREENVOLT	6,690	-2,48	5,35

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	6,63
ALTRI	1,08
NOS	0,99
EDP R	-1,34
EDP	-1,50
GALP	-1,78
BCP	-1,81
GREENVOLT	-2,48



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI	5.834,05	-0,84%	4,75%	6.153,32	4.859,53
CAC40	6.398,93	-1,19%	-10,54%	7.384,86	5.756,38
ESTX 50 PR	3.727,84	-0,89%	-13,27%	4.415,23	3.387,00
XTRA DAX	13.983,01	-0,40%	-11,97%	16.290,19	12.438,85
S&P 500	4.150,62	-0,58%	-12,90%	4.818,62	4.056,88
IBEX 35	8.500,30	-1,05%	-2,45%	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.