

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

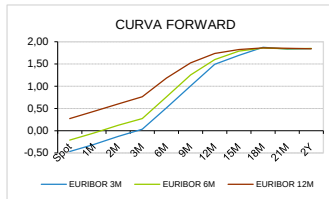
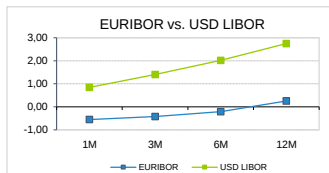
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

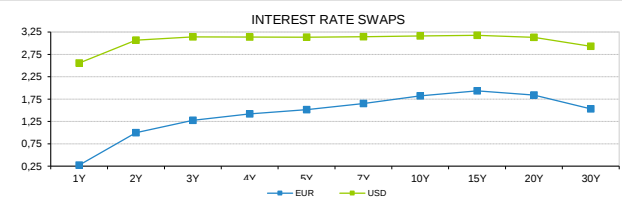
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP	CHF
1M	-0,5530	-1	-1	1M	0,8451	1	42	0,9881	-0,6250
3M	-0,4210	1	5	3M	1,4061	4	44	1,1796	-0,5125
6M	-0,2060	0	17	6M	2,0196	4	53	1,5123	-0,4600
12M	0,2530	2	35	12M	2,7484	5	55	1,9569	-0,7000

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2723	-1	33	1,7340	1,8710	1,9585
2Y	0,9980	-1	38	1,7905	1,8828	2,0061
3Y	1,2747	0	37	1,8120	1,9090	2,0570
4Y	1,4196	2	40	1,8380	1,9445	2,1075
5Y	1,5140	3	43	1,8594	1,9870	2,1555
7Y	1,6488	5	49	1,9290	2,0740	2,1940
10Y	1,8205	6	55	2,0370	2,1290	2,1700
15Y	1,9340	7	57	2,0530	2,0360	1,9698
20Y	1,8391	8	53	1,9017	1,8320	1,7330
30Y	1,5299	8	44	1,5600	1,4840	1,3970

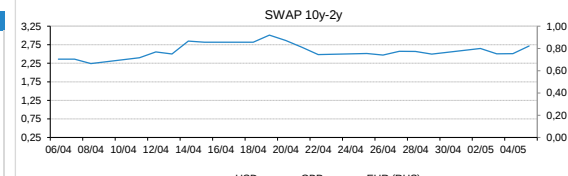
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,00
Reino Unido	1,00
Japão	0,10
Canadá	1,00
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	12,75
Austrália	0,35
Índia	4,50



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5559	4	48	3,5390	3,1220	3,1125
2Y	3,0673	8	34	3,4114	3,1110	3,1360
3Y	3,1417	9	31	3,3189	3,1095	3,1440
4Y	3,1394	10	34	3,2504	3,1215	3,1570
5Y	3,1345	12	39	3,2365	3,1300	3,1998
7Y	3,1458	13	49	3,2190	3,1530	3,1770
10Y	3,1630	14	57	3,2170	3,1757	3,1500
15Y	3,1762	14	62	3,1845	3,1220	3,0000
20Y	3,1314	14	61	3,0945	3,0493	2,9580
30Y	2,9314	13	57	2,9055	2,8027	2,7506

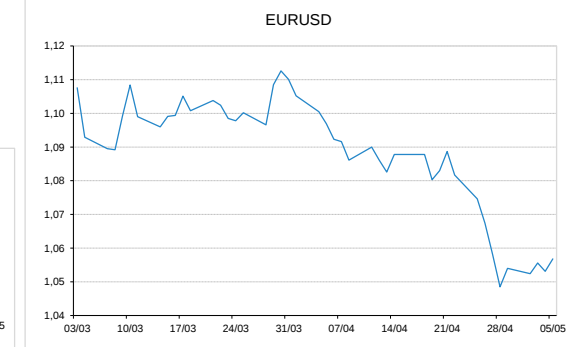
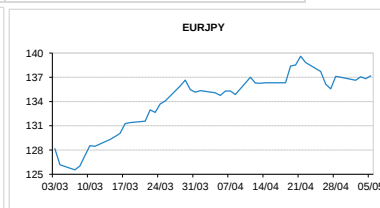
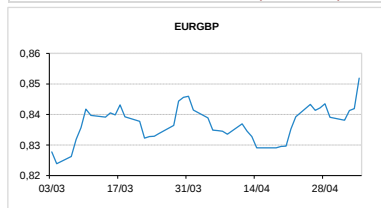


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	111,45	1,31	6,25	OT 2Y	0,468	0,01	47,20
JETFUEL	1.296,36	33,36	130,47	OT 5Y	1,461	0,05	72,80
DIESEL	1.187,37	22,87	90,42	OT 10Y	2,172	0,07	65,90
COBRE	9.510,00	63,50	-995,50	BUND 10Y	0,594	6,77	42,20
ZINCO	3.983,25	-0,50	-418,50	SCHATZ 2Y	0,874	0,47	24,90
OURO	1.878,68	-2,54	-44,92	T-NOTE 10Y	3,825	13,29	32,30
TRIGO	1.096,25	19,75	50,75	T-NOTE 2Y	3,210	11,19	8,50
LICENÇA C02	89,14	0,83	11,09	GILT 10Y	2,012	-1,01	28,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0568	0,35%	-3,66%	1,0619	1,0687	1,0838
EUR/GBP	0,8519	-1,17%	-2,00%	0,8556	0,8598	0,8679
EUR/JPY	137,18	-0,25%	-1,76%	137,18	137,18	137,18
EUR/CHF	1,0374	-0,43%	-2,28%	1,0369	1,0360	1,0343
EUR/BRL	5,3038	-1,49%	-4,38%	5,4793	5,6512	5,9815
EUR/PLN	4,6943	-0,95%	-1,04%	4,7758	4,8695	5,0413



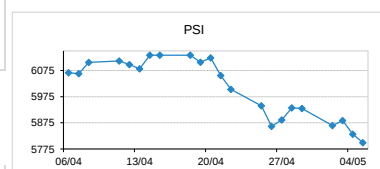
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0568	0,8519	137,18	1,0374	10,4647	7,4398	1,3492	1,47846	5,3038	9,9800
USD	0,9495	-	0,8082	130,245	0,9852	9,9206	7,0643	1,2817	1,4017	5,0193	9,4801

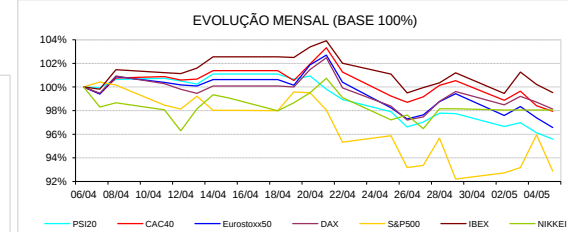
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,630	1,77	18,18
BCP	0,144	-1,71	1,92
CORT. AMORIM	10,440	-0,19	-7,45
CTT	4,230	-0,47	-7,14
EDP	4,288	-1,08	-11,26
EDP R	20,750	-2,90	-5,25
GALP	10,925	-0,41	28,23
J MARTINS	20,300	2,42	1,00
MOTA ENGIL	1,286	2,06	0,78
NAVIGATOR	3,932	0,61	17,37
NOS	3,792	-7,38	11,20
REN	2,880	0,70	13,16
SEMAPA	13,220	1,54	12,99
SONAE SGPS	1,039	0,97	3,59
GREENVOLT	6,760	0,60	6,46

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
J MARTINS	2,42
MOTA ENGIL	2,06
ALTRI	1,77
SEMAPA	1,54
SONAE SGPS	0,97
CTT	-0,47
EDP	-1,08
BCP	-1,71
EDP R	-2,90
NOS	-7,38



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI	5.799,20	-0,56%	4,12%	6.153,32	4.859,53
CAC40	6.365,36	-0,47%	-11,01%	7.384,86	5.756,38
ESTX 50 PR	3.693,41	-0,85%	-14,07%	4.415,23	3.387,00
XTRA DAX	13.888,06	-0,59%	-12,57%	16.290,19	12.438,85
S&P 500	4.161,79	-3,22%	-12,68%	4.818,62	4.056,88
IBEX 35	8.442,40	-0,68%	-3,11%	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.