

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

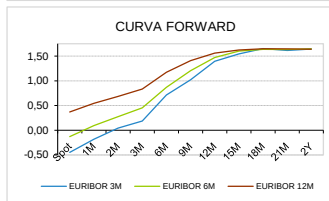
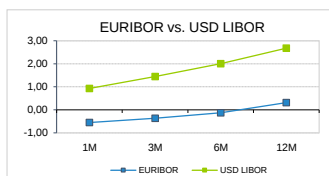
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

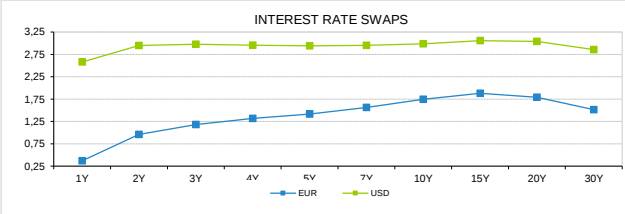
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP	CHF
1M	-0,5520	-1	-1	1M	0,9284	-1	33	0,9504	-0,6250
3M	-0,3680	1	8	3M	1,4476	-1	38	1,2010	-0,5250
6M	-0,1260	4	19	6M	2,0051	-1	45	1,4915	-0,4300
12M	0,3130	7	31	12M	2,6777	2	46	1,8656	-0,7000

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,3700	4	35	1,5570	1,7280	1,9010
2Y	0,9604	3	24	1,5950	1,7835	1,9480
3Y	1,1803	2	15	1,6440	1,8240	2,0040
4Y	1,3165	2	13	1,6885	1,8625	2,0585
5Y	1,4141	0	13	1,7305	1,9110	2,1059
7Y	1,5610	0	15	1,8190	2,0105	2,1660
10Y	1,7462	-2	17	1,9495	2,0885	2,1438
15Y	1,8798	-2	18	1,9890	1,9980	1,9420
20Y	1,7906	-3	16	1,8453	1,8030	1,7200
30Y	1,5122	-3	12	1,5370	1,4810	1,4050

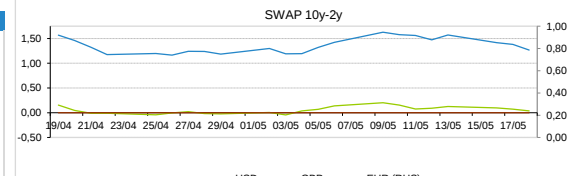
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,00
Reino Unido	1,00
Japão	0,10
Canadá	1,00
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	12,75
Austrália	0,35
Índia	4,50



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5788	0	44	3,2863	2,8785	2,9310
2Y	2,9496	-3	23	3,1531	2,8760	2,9720
3Y	2,9763	-5	15	3,0650	2,8980	2,9820
4Y	2,9543	-6	12	3,0210	2,9240	3,0000
5Y	2,9401	-6	10	3,0055	2,9330	3,0412
7Y	2,9517	-6	8	3,0050	2,9680	3,0700
10Y	2,9865	-7	9	3,0330	3,0585	3,0980
15Y	3,0564	-7	14	3,0834	3,0557	3,0540
20Y	3,0392	-7	16	3,0285	2,9882	2,9250
30Y	2,8561	-7	14	2,8375	2,7400	2,6682

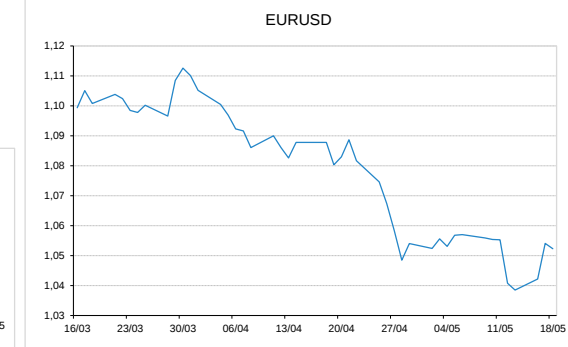
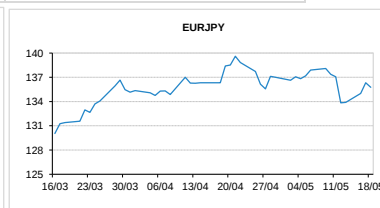
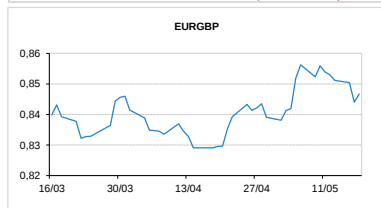


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	109,63	-2,30	-2,31	OT 2Y	0,430	0,03	7,50
JETFUEL	1.166,30	-33,97	-39,96	OT 5Y	1,396	0,01	27,10
DIESEL	1.096,25	-5,50	-39,44	OT 10Y	2,155	-0,01	32,00
COBRE	9.336,00	127,50	-949,00	BUND 10Y	0,543	-3,50	15,60
ZINCO	3.670,25	100,75	-755,25	SCHATZ 2Y	0,822	1,17	14,60
OURO	1.823,63	8,48	-155,28	T-NOTE 10Y	3,683	-4,07	4,40
TRIGO	1.222,50	-55,00	93,75	T-NOTE 2Y	3,102	-2,94	7,30
LICENÇA C02	84,74	-6,98	4,77	GILT 10Y	1,897	-2,30	-2,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0523	-0,17%	-3,26%	1,0577	1,0640	1,0782
EUR/GBP	0,8467	-0,32%	-2,08%	0,8505	0,8545	0,8622
EUR/JPY	135,76	0,41%	0,41%	135,76	135,76	135,75
EUR/CHF	1,0393	0,87%	-1,97%	1,0388	1,0374	1,0347
EUR/BRL	5,2213	-0,19%	-3,92%	5,3882	5,5494	5,8748
EUR/PLN	4,6437	0,16%	-0,41%	4,7264	4,8121	4,9729



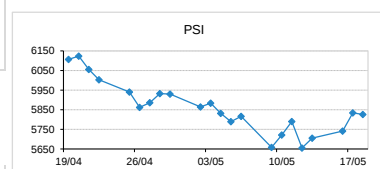
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0523	0,8467	135,76	1,0393	10,5094	7,4411	1,3481	1,49945	5,2213	10,2809
USD	0,9514	-	0,8055	128,5	0,9895	9,9682	7,0801	1,2815	1,4264	4,9607	9,7584

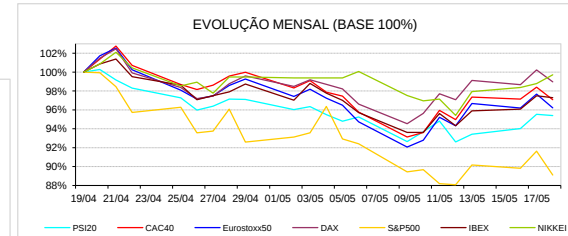
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,140	-4,10	23,09
BCP	0,167	1,65	18,31
CORT. AMORIM	9,990	-1,48	-11,44
CTT	3,680	-3,16	-19,21
EDP	4,531	1,14	-6,23
EDP R	20,620	-0,58	-5,84
GALP	10,885	1,73	27,76
J MARTINS	18,190	-3,30	-9,50
MOTA ENGIL	1,286	0,00	0,78
NAVIGATOR	4,072	-0,54	21,55
NOS	3,860	-0,41	13,20
REN	2,865	2,14	12,57
SEMAPA	14,100	-0,42	20,51
SONAE SGPS	1,011	-0,59	0,80
GREENVOLT	6,790	-0,88	6,93

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
REN	2,14
GALP	1,73
BCP	1,65
EDP	1,14
GREENVOLT	-0,88
CORT. AMORIM	-1,48
CTT	-3,16
J MARTINS	-3,30
ALTRI	-4,10



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI	5.825,81	-0,14%	4,60%	6.153,32	4.859,53
CAC40	6.344,32	-1,34%	-11,31%	7.384,86	5.756,38
ESTX 50 PR	3.685,94	-1,49%	-14,25%	4.415,23	3.387,00
XTRA DAX	14.006,81	-1,26%	-11,82%	16.290,19	12.438,85
S&P 500	3.978,74	-2,75%	-16,57%	4.818,62	3.858,87
IBEX 35	8.459,30	-0,19%	-2,92%	9.310,80	7.287,70
NIKKEI 225	26.911,20	0,94%	-6,53%	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.