

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

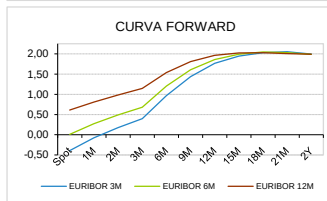
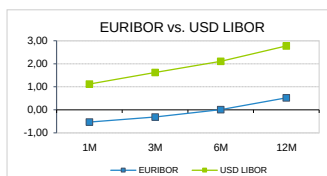
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

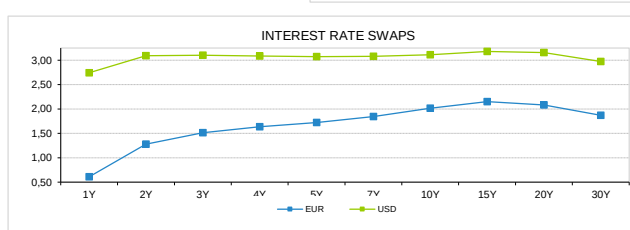
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP	CHF
1M	-0,5310	1	2	1M	1,1197	0	32	1,0922	-0,6000
3M	-0,3140	1	11	3M	1,6260	2	29	1,2991	-0,3300
6M	0,0090	2	22	6M	2,1093	0	20	1,5976	-0,2600
12M	0,5210	4	28	12M	2,7754	4	15	2,0509	-0,7000

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,6092	2	30	1,9560	2,0310	2,1300
2Y	1,2799	2	21	1,9731	2,0570	2,1730
3Y	1,5120	2	14	1,9900	2,0800	2,2300
4Y	1,6360	2	12	2,0140	2,1130	2,2860
5Y	1,7235	2	10	2,0350	2,1600	2,3327
7Y	1,8451	3	9	2,1030	2,2520	2,3980
10Y	2,0155	4	9	2,2192	2,3320	2,3976
15Y	2,1509	3	10	2,2680	2,2700	2,2282
20Y	2,0830	3	14	2,1501	2,1140	2,0543
30Y	1,8720	4	26	1,9095	1,8620	1,8040

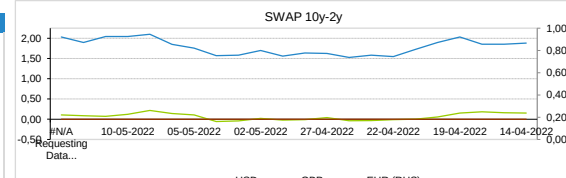
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,00
Reino Unido	1,00
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	12,75
Austrália	0,35
Índia	4,50



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7428	3	20	3,4447	3,0271	3,0902
2Y	3,0909	6	4	3,2729	2,9995	3,0630
3Y	3,1035	7	-3	3,1460	3,0389	3,0820
4Y	3,0850	8	-7	3,0905	3,0295	3,1242
5Y	3,0721	9	-9	3,1369	3,0480	3,1573
7Y	3,0784	9	-10	3,1140	3,0900	3,1400
10Y	3,1114	9	-8	3,1691	3,1766	3,1660
15Y	3,1795	10	-3	3,1790	3,1550	3,1915
20Y	3,1574	10	-1	3,1285	3,0953	3,0315
30Y	2,9735	10	1	2,9080	2,8075	2,7790

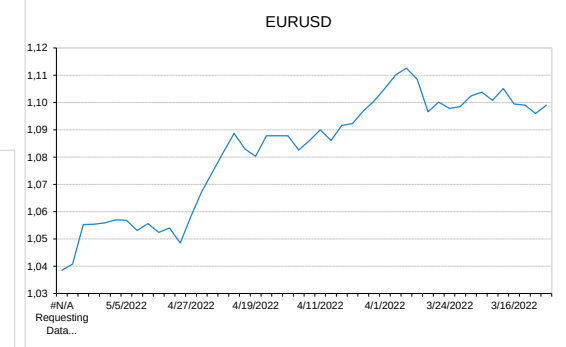
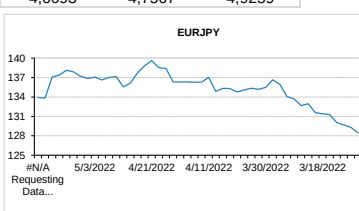


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	119,50	-0,22	8,66	OT 2Y	0,904	0,09	-0,50
JETFUEL	1.395,02	26,63	132,02	OT 5Y	1,755	0,03	18,60
DIESEL	1.337,94	26,55	173,44	OT 10Y	2,509	0,04	29,90
COBRE	9.520,00	52,00	-270,00	BUND 10Y	0,836	4,09	15,80
ZINCO	3.877,50	-51,50	-247,75	SCHATZ 2Y	1,395	2,63	-0,20
OURO	1.841,88	-9,32	-41,93	T-NOTE 10Y	3,813	5,47	15,60
TRIGO	1.097,25	57,25	-11,25	T-NOTE 2Y	3,283	5,51	13,10
LICENÇA C02	81,97	-4,90	-9,57	GILT 10Y	2,342	11,39	-8,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0726	-0,04%	1,48%	1,0782	1,0842	1,0971
EUR/GBP	0,85415	0,01%	0,25%	0,8580	0,8618	0,8693
EUR/JPY	140,16	-0,41%	-1,61%	140,16	140,16	140,15
EUR/CHF	1,0365	-0,47%	0,57%	1,0361	1,0350	1,0326
EUR/BRL	5,1303	-0,22%	4,47%	5,2935	5,4502	5,7611
EUR/PLN	4,5870	0,04%	2,73%	4,6693	4,7567	4,9259



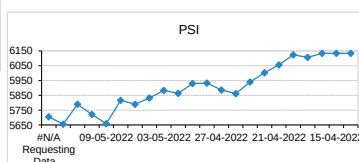
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0726	0,8542	140,16	1,0365	10,4656	7,4391	1,3452	1,48557	5,1303	10,0712
USD	0,9328	-	0,7963	131,325	0,9661	9,7549	6,9393	1,2546	1,3849	4,7922	9,3851

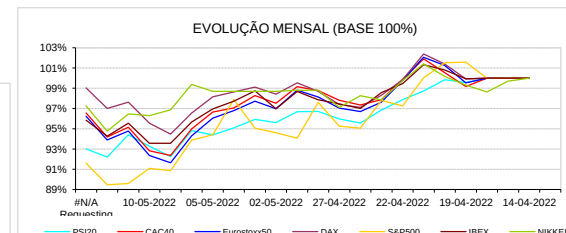
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,200	0,32	48,48
BCP	0,195	2,57	38,61
CORT. AMORIM	10,420	0,00	-7,62
CTT	3,775	0,67	-17,12
EDP	4,725	1,29	-2,21
EDP R	23,110	1,36	5,53
GALP	12,215	0,53	43,37
J MARTINS	18,920	-0,11	-5,87
MOTA ENGIL	1,336	2,30	4,70
NAVIGATOR	4,032	-0,35	20,36
NOS	3,946	-0,05	15,72
REN	2,895	0,87	13,75
SEMAPA	15,900	1,27	35,90
SONAE SGPS	1,105	-0,63	10,17
GREENVOLT	7,500	3,88	18,11

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
GREENVOLT	3,88
BCP	2,57
MOTA ENGIL	2,30
EDP R	1,36
EDP	1,29
NOS	-0,05
J MARTINS	-0,11
NAVIGATOR	-0,35
SONAE SGPS	-0,63



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI	6.273,37	0,82%	12,64%	6.344,23	4.859,53
CAC40	6.548,78	0,98%	-8,45%	7.384,86	5.756,38
ESTX 50 PR	3.838,42	1,45%	-10,70%	4.415,23	3.387,00
XTRA DAX	14.653,81	1,34%	-7,75%	16.290,19	12.438,85
S&P 500	4.141,78	0,78%	-13,13%	4.818,62	3.810,32
IBEX 35	8.836,30	1,28%	1,41%	9.310,80	7.287,70
NIKKEI 225	27.915,89	0,56%	-3,04%	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.