

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

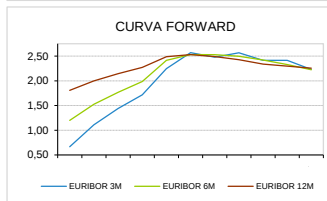
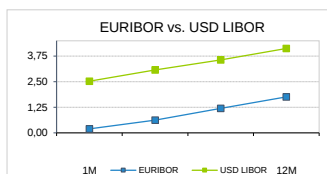
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

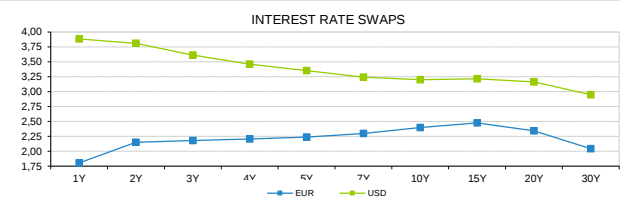
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP	CHF
1M	0,1960	8	27	1M	2,5239	3	18	1,8896	-0,2450
3M	0,6200	4	39	3M	3,0696	3	28	2,2963	0,1475
6M	1,1930	12	54	6M	3,5664	4	22	2,8309	0,5800
12M	1,7580	15	84	12M	4,1233	3	32	3,4967	-0,7000

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,8043	8	84	2,4803	2,3100	2,4310
2Y	2,1494	6	102	2,3790	2,3370	2,4580
3Y	2,1800	3	99	2,3545	2,3660	2,4970
4Y	2,2062	2	95	2,3565	2,3940	2,5350
5Y	2,2376	0	91	2,3720	2,4330	2,5785
7Y	2,2977	-1	84	2,4150	2,5050	2,6320
10Y	2,3980	-2	77	2,5010	2,5730	2,6180
15Y	2,4753	-2	69	2,5156	2,4695	2,3910
20Y	2,3435	-1	62	2,3470	2,2620	2,1680
30Y	2,0414	-2	53	2,0310	1,9515	1,8740

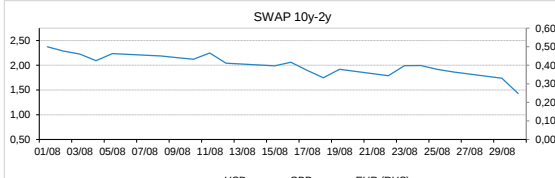
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,50
EUA	2,50
Reino Unido	1,75
Japão	0,10
Canadá	2,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	13,75
Austrália	1,85
Índia	4,50



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	3,8840	5	52	3,6788	2,9385	2,9145
2Y	3,8100	5	65	3,4409	2,9105	2,9460
3Y	3,6126	3	69	3,2820	2,9140	2,9330
4Y	3,4606	2	68	3,1902	2,9170	2,9886
5Y	3,3515	1	65	3,1340	2,9265	3,0238
7Y	3,2429	1	59	3,0820	2,9750	3,0625
10Y	3,2008	0	53	3,1163	3,0664	3,1060
15Y	3,2153	-1	44	3,1365	3,0661	3,0640
20Y	3,1623	-2	38	3,0801	2,9909	2,9350
30Y	2,9484	-3	30	2,8540	2,7495	2,6835

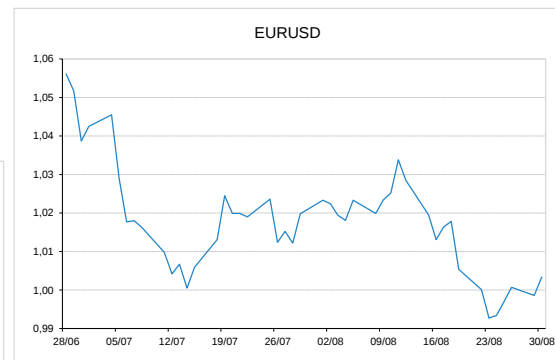
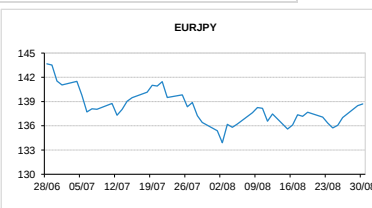
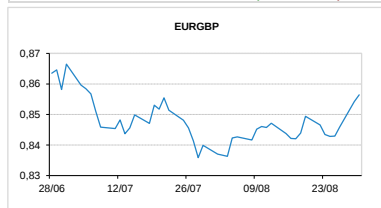


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	99,44	-5,65	-4,53	OT 2Y	1,073	0,06	56,20
JETFUEL	1.237,75	-17,23	105,74	OT 5Y	1,895	0,00	86,60
DIESEL	1.192,75	-17,23	92,24	OT 10Y	2,590	0,00	75,00
COBRE	8.129,00	31,50	624,00	BUND 10Y	0,913	1,65	73,70
ZINCO	3.639,50	23,50	564,50	SCHATZ 2Y	1,539	6,23	67,00
OURO	1.726,15	-12,00	-39,79	T-NOTE 10Y	3,926	0,17	44,70
TRIGO	828,25	-14,50	2,50	T-NOTE 2Y	3,774	3,58	49,70
LICENÇA C02	80,97	-5,69	2,42	GILT 10Y	2,938	11,96	86,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0034	0,48%	-1,94%	1,0096	1,0163	1,0266
EUR/GBP	0,85645	-0,26%	-2,27%	0,8603	0,8647	0,8742
EUR/JPY	138,71	-0,16%	-2,40%	138,71	138,70	138,68
EUR/CHF	0,9760	-0,62%	-0,02%	0,9746	0,9726	0,9683
EUR/BRL	5,0862	-1,03%	4,75%	5,2307	5,3729	5,6476
EUR/PLN	4,7223	0,17%	-0,10%	4,8220	4,9165	5,0729



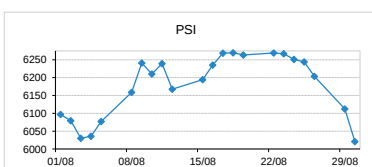
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0034	0,8565	138,71	0,9760	10,6863	7,4374	1,3115	1,45675	5,0862	9,8228
USD	1,0014	-	0,86	138,96	0,9760	10,7093	7,4479	1,3100	1,4568	5,0652	9,8314

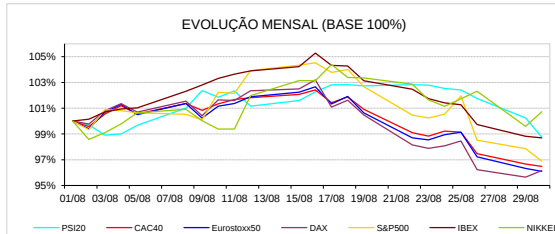
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,535	0,00	32,55
BCP	0,145	2,40	2,98
CORT. AMORIM	10,080	-1,56	-10,64
CTT	3,230	0,31	-29,09
EDP	4,885	-2,77	1,10
EDP R	24,450	-1,45	11,64
GALP	10,930	-3,53	28,29
J MARTINS	21,600	-2,35	7,46
MOTA ENGIL	1,200	-0,33	-5,96
NAVIGATOR	3,962	-0,70	18,27
NOS	3,690	-0,54	8,21
REN	2,685	-1,29	5,50
SEMAPA	14,000	-0,71	19,66
SONAE SGPS	1,001	-1,38	-0,20
GREENVOLT	9,650	-3,69	55,39

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	2,40
CTT	0,31
CORT. AMORIM	-1,56
J MARTINS	-2,35
EDP	-2,77
GALP	-3,53
GREENVOLT	-3,69



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI	6.020,56	-1,50%	8,10%	6.370,78	5.163,65
CAC40	6.210,22	-0,19%	-13,18%	7.384,86	5.756,38
ESTX 50 PR	3.561,92	-0,24%	-17,13%	4.415,23	3.357,06
XTRA DAX	12.961,14	0,53%	-18,41%	16.290,19	12.390,95
S&P 500	3.988,33	-0,94%	-16,23%	4.818,62	3.636,87
IBEX 35	7.979,80	-0,06%	-8,36%	9.198,10	7.287,70
NIKKEI 225	28.195,58	1,14%	-2,07%	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.