

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

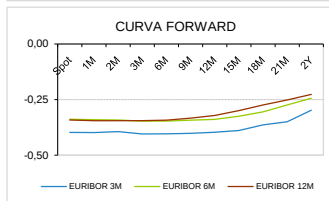
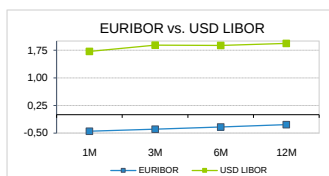
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

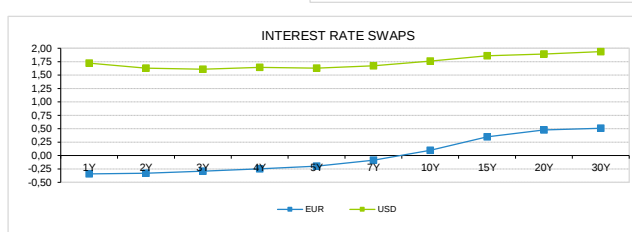
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,4480	0	2	1M	1,7176	0	-4	0,7096
3M	-0,3930	0	0	3M	1,8884	0	-1	0,7834
6M	-0,3330	0	-1	6M	1,8801	-1	-4	0,8625
12M	-0,2690	1	-1	12M	1,9353	1	-6	0,9635

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3425	0	0	-0,3227	-0,1027	0,1431
2Y	-0,3290	0	0	-0,2739	-0,0403	0,2060
3Y	-0,2920	0	0	-0,2165	0,0208	0,2760
4Y	-0,2470	0	-1	-0,1563	0,0830	0,3450
5Y	-0,1970	0	-2	-0,0964	0,1500	0,4090
7Y	-0,0860	-1	-3	0,0289	0,2790	0,5169
10Y	0,0970	-1	-5	0,2155	0,4385	0,6406
15Y	0,3480	0	-6	0,4365	0,5913	0,7245
20Y	0,4760	0	-6	0,5416	0,6410	0,7152
30Y	0,5080	0	-7	0,5484	0,5982	0,6306

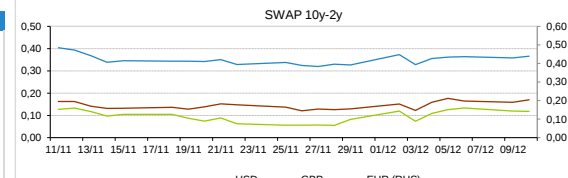
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,00
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7210	1	-5	1,5600	1,6320	1,7500
2Y	1,6300	2	-2	1,5815	1,6670	1,7939
3Y	1,6090	2	-1	1,5900	1,6930	1,8289
4Y	1,6430	6	11	1,6180	1,7389	1,8656
5Y	1,6290	3	1	1,6420	1,7701	1,9019
7Y	1,6720	3	1	1,7130	1,8358	1,9320
10Y	1,7590	3	1	1,7880	1,9053	1,9941
15Y	1,8610	2	31	1,8930	1,9679	2,0315
20Y	1,8930	29	29	1,9265	1,9902	2,0308
30Y	1,9370	2	1	1,9335	1,9778	1,9919

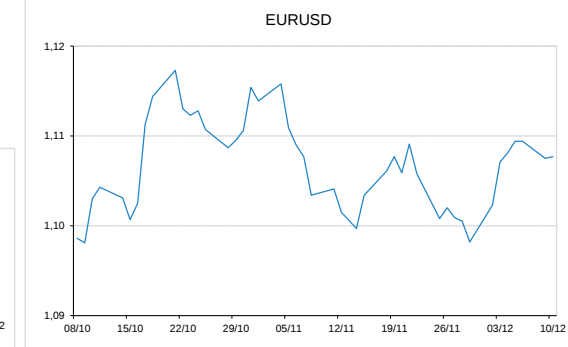
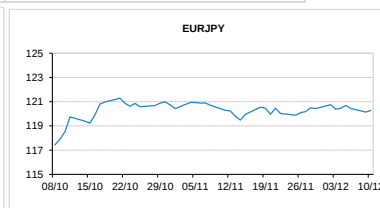
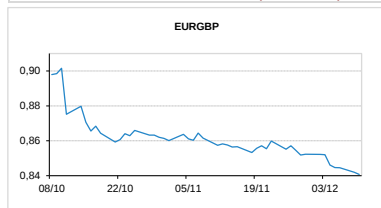


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,39	0,14	2,77	OT 2Y	-0,549	0,00	-3,30
JETFUEL	606,75	0,00	-12,70	OT 5Y	-0,113	0,01	2,10
DIESEL	589,45	-2,74	5,76	OT 10Y	0,393	0,00	6,90
COBRE	6.081,50	85,00	152,00	BUND 10Y	-0,879	0,96	-5,00
ZINCO	2.244,00	-1,50	-260,50	SCHATZ 2Y	0,000	0,00	-1,60
OURO	1.463,29	3,28	1,48	T-NOTE 10Y	2,694	1,54	-4,50
TRIGO	522,00	-0,75	7,75	T-NOTE 2Y	2,070	2,29	0,00
LICENÇA C02	24,95	-0,18	0,11	GILT 10Y	0,719	3,19	1,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1077	0,02%	0,33%	1,1147	1,1210	1,1334
EUR/GBP	0,84073	0,15%	1,99%	0,8434	0,8462	0,8519
EUR/JPY	120,27	-0,10%	0,02%	120,27	120,27	120,27
EUR/CHF	1,0927	0,05%	0,35%	1,0918	1,0910	1,0894
EUR/BRL	4,5942	-0,30%	-0,39%	4,6416	4,6849	4,7998
EUR/PLN	4,2890	-0,07%	-0,35%	4,3142	4,3388	4,3872



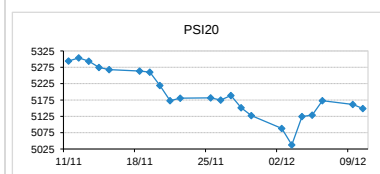
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1077	0,8407	120,27	1,0927	10,5374	7,4733	1,4673	1,6277	4,5942	10,1737
USD	0,9019	-	0,7594	108,695	0,9862	9,5062	6,7403	1,3234	1,4690	4,1436	9,1705

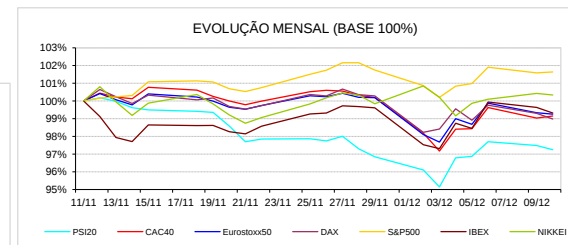
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,755	-0,17	-0,60
BCP	0,193	-0,05	-15,73
CORT. AMORIM	11,420	2,88	26,89
CTT	3,316	-0,90	12,56
EDP	3,681	0,27	20,43
EDP R	10,120	0,80	30,16
GALP	14,215	-1,79	3,30
IBERSOL	7,640	-0,78	-3,29
J MARTINS	14,700	-0,37	42,17
MOTA ENGIL	1,827	0,11	13,48
NAVIGATOR	3,580	-0,55	-0,33
NOS	4,994	-0,22	-5,68
NOVABASE	2,750	-0,36	43,07
PHAROL	0,103	-1,35	-37,25
RAMADA	5,960	0,34	-20,53
REN	13,880	-0,29	5,95
SEMAPA	0,769	-1,41	-9,42
SONAE CAP.	0,934	-0,95	15,31
SONAE SGPS	5,960	0,34	-20,53

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	2,88
EDP R	0,80
RAMADA	0,34
RAMADA	0,34
EDP	0,27
CTT	-0,90
SONAE CAP.	-0,95
PHAROL	-1,35
SEMAPA	-1,41
GALP	-1,79



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.148,84	-0,25%	8,82%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.843,92	0,11%	23,53%	5.966,79	4.555,99
ESTX 50 PR	3.669,27	-0,08%	22,25%	3.733,45	2.908,70
XTRA DAX	13.066,63	-0,31%	23,73%	13.374,27	10.279,20
S&P 500	3.137,55	0,05%	25,16%	3.154,26	2.346,58
IBEX 35	9.324,70	-0,32%	9,19%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	23.410,19	-0,09%	16,96%	23.608,06	18.948,58



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.