

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

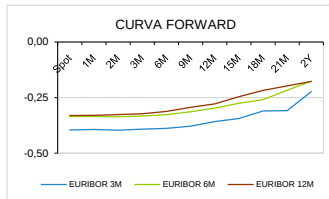
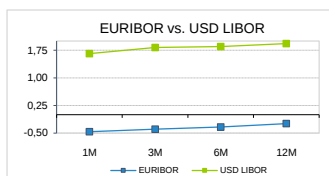
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

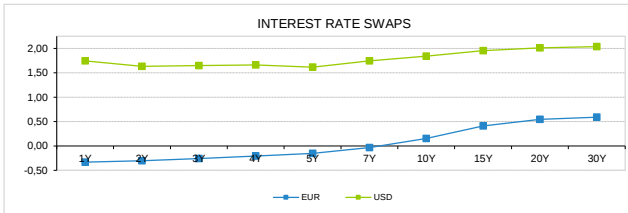
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,4620	0	0	1M	1,6578	-1	-9	0,6581
3M	-0,3910	0	1	3M	1,8266	-1	-7	0,7238
6M	-0,3320	0	1	6M	1,8488	-2	-4	0,7635
12M	-0,2420	1	2	12M	1,9301	-2	-3	0,8196
								-0,4988

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3315	0	1	-0,2799	-0,0570	0,1842
2Y	-0,3030	0	2	-0,2276	0,0010	0,2490
3Y	-0,2580	0	3	-0,1708	0,0620	0,3170
4Y	-0,2060	0	4	-0,1131	0,1250	0,3850
5Y	-0,1510	0	5	-0,0539	0,1910	0,4490
7Y	-0,0330	0	6	0,0707	0,3197	0,5585
10Y	0,1540	0	7	0,2562	0,4850	0,6853
15Y	0,4110	0	8	0,4875	0,6485	0,7772
20Y	0,5470	0	9	0,5931	0,6966	0,7742
30Y	0,5900	0	10	0,6078	0,6594	0,6941

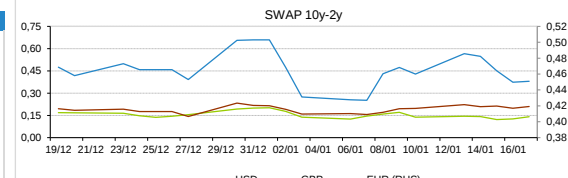
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7450	3	1	1,5664	1,5950	1,7745
2Y	1,6340	0	-1	1,5729	1,6545	1,8190
3Y	1,6480	7	4	1,5906	1,6715	1,8540
4Y	1,6600	8	2	1,6050	1,7360	1,8870
5Y	1,6160	0	-3	1,6546	1,7908	1,9437
7Y	1,7440	9	7	1,7080	1,8420	1,9740
10Y	1,8400	9	9	1,8060	1,9210	2,0190
15Y	1,9530	9	9	1,9050	2,0086	2,0580
20Y	2,0120	11	12	1,9728	2,0120	2,0530
30Y	2,0370	10	11	1,9754	2,0025	2,0155

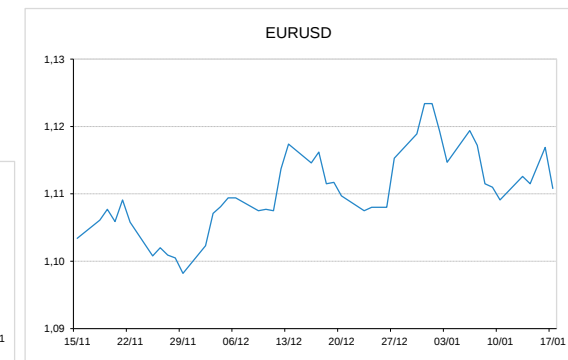
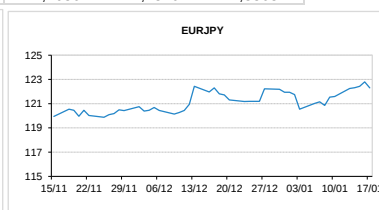


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,71	0,09	-0,44	OT 2Y	-0,354	-0,02	19,00
JETFUEL	612,55	-5,16	-39,77	OT 5Y	0,039	-0,03	17,10
DIESEL	572,00	-6,51	-47,20	OT 10Y	0,499	-0,02	10,60
COBRE	6.269,00	-9,50	78,50	BUND 10Y	-0,841	0,42	-1,20
ZINCO	2.434,75	41,00	138,75	SCHATZ 2Y	0,039	0,00	2,50
OURO	1.558,48	6,91	81,28	T-NOTE 10Y	2,666	0,61	-9,10
TRIGO	567,00	1,75	10,75	T-NOTE 2Y	2,032	0,00	-5,20
LICENÇA C02	25,32	0,47	-0,75	GILT 10Y	-2,870	-0,74	-15,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1108	-0,55%	-0,48%	1,1171	1,1233	1,1358
EUR/GBP	0,85105	0,43%	-0,42%	0,8534	0,8557	0,8603
EUR/JPY	122,31	0,40%	0,00%	122,31	122,31	122,31
EUR/CHF	1,0740	0,04%	1,80%	1,0732	1,0724	1,0705
EUR/BRL	4,6482	0,23%	-2,37%	4,6745	4,7157	4,8474
EUR/PLN	4,2417	-0,27%	0,46%	4,2636	4,2870	4,3368



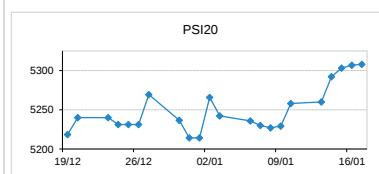
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1108	0,8511	122,31	1,0740	10,5534	7,4727	1,4502	1,61337	4,6482	9,8888
USD	0,9013	-	0,7675	110,145	0,9679	9,5148	6,7351	1,3059	1,4537	4,1832	8,9082

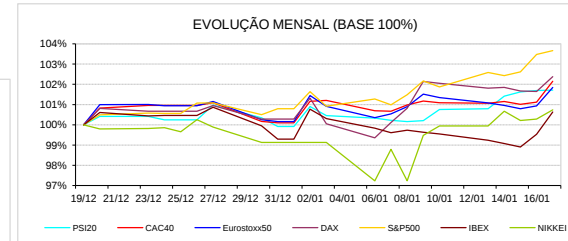
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,150	3,36	8,27
BCP	0,193	-1,43	-5,08
CORT. AMORIM	11,500	-0,35	1,77
CTT	3,252	0,18	1,94
EDP	4,117	0,98	6,55
EDP R	10,820	0,37	3,05
GALP	15,020	-0,83	0,81
IBERSOL	8,640	2,86	8,00
J MARTINS	15,650	0,06	6,72
MOTA ENGIL	1,805	-1,04	-3,48
NAVIGATOR	3,354	-0,77	-2,74
NOS	4,958	0,61	3,29
NOVABASE	2,690	0,00	4,26
PHAROL	0,101	-0,59	1,61
RAMADA	5,820	0,34	-0,34
REN	13,160	-0,15	-4,08
SEMAPA	0,796	0,63	5,71
SONAE CAP.	0,882	-0,17	-3,13
SONAE SGPS	5,820	0,34	-0,34

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	3,36
IBERSOL	2,86
EDP	0,98
SEMAPA	0,63
NOS	0,61
PHAROL	-0,59
NAVIGATOR	-0,77
GALP	-0,83
MOTA ENGIL	-1,04
BCP	-1,43



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.307,98	0,02%	1,80%	5.429,32	4.699,20
CAC40	6.100,72	1,02%	2,05%	6.109,81	4.772,64
ESTX 50 PR	3.808,14	0,90%	1,68%	3.813,80	3.053,08
XTRA DAX	13.526,13	0,72%	2,09%	13.557,78	10.822,25
S&P 500	3.322,91	0,18%	2,85%	3.326,44	2.606,36
IBEX 35	9.678,20	1,10%	1,35%	9.709,90	8.409,20
NIKKEI 225	24.041,26	0,45%	1,63%	24.115,95	20.110,76



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.