

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

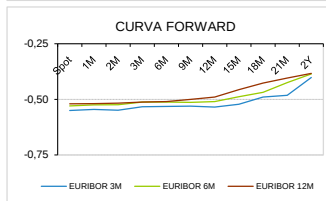
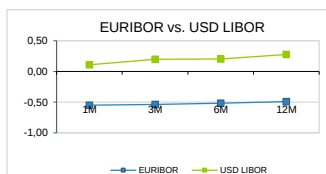
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

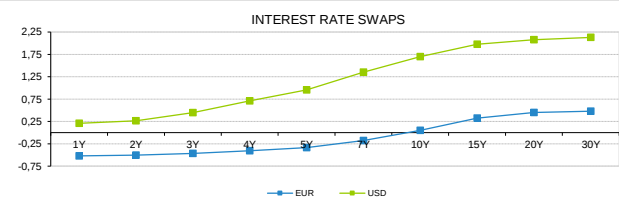
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5490	0	0	1M	0,1084	0	-1	0,0501
3M	-0,5380	0	1	3M	0,1969	1	2	0,0813
6M	-0,5180	0	0	6M	0,2024	0	1	0,1040
12M	-0,4910	-1	0	12M	0,2763	0	-1	0,1618
								CHF LIBOR
								-0,7980
								-0,7518
								-0,7084
								-0,5944

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5202	0	-1	-0,4907	-0,2307	0,1230
2Y	-0,5050	0	-1	-0,4377	-0,1468	0,2110
3Y	-0,4645	-1	0	-0,3677	-0,0565	0,2887
4Y	-0,4053	-1	0	-0,2904	0,0330	0,3636
5Y	-0,3360	-1	1	-0,2080	0,1145	0,4360
7Y	-0,1777	-1	3	-0,0422	0,2654	0,5428
10Y	0,0490	-1	6	0,1767	0,4390	0,6560
15Y	0,3240	-1	9	0,4140	0,5870	0,7180
20Y	0,4500	-1	10	0,5073	0,6178	0,6965
30Y	0,4790	-1	12	0,5072	0,5640	0,6007

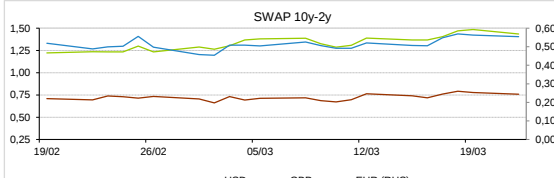
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,75
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2080	1	3	0,3214	1,5077	2,3149
2Y	0,2648	0	6	0,5540	1,7442	2,4037
3Y	0,4480	-1	12	0,8768	1,9099	2,4539
4Y	0,7086	-2	18	1,1260	2,0390	2,4890
5Y	0,9566	-2	23	1,3713	2,1601	2,5168
7Y	1,3524	-4	27	1,6851	2,2832	2,5210
10Y	1,6985	-5	26	1,9478	2,3846	2,5380
15Y	1,9747	-5	23	2,1372	2,4035	2,5115
20Y	2,0777	-5	22	2,1795	2,4180	2,4953
30Y	2,1291	-6	19	2,2029	2,3435	2,3620

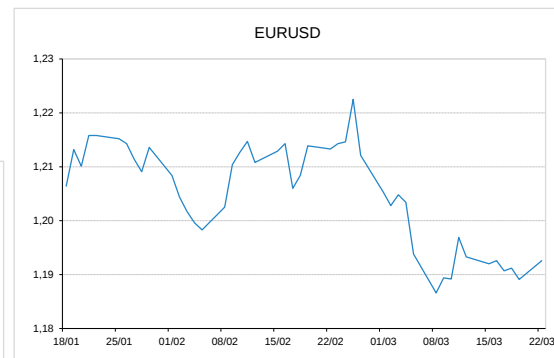
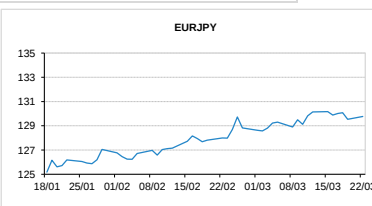
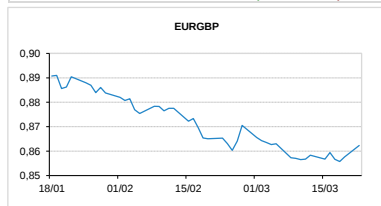


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,30	-0,23	-0,06	OT 2Y	-0,613	-0,01	-6,70
JETFUEL	528,37	-3,13	-16,13	OT 5Y	-0,280	-0,01	-7,30
DIESEL	514,82	-3,43	-19,18	OT 10Y	0,220	-0,01	-2,10
COBRE	9 066,00	1,50	147,50	BUND 10Y	-0,827	-1,80	2,20
ZINCO	2 827,00	44,25	-49,00	SCHATZ 2Y	-0,057	-0,23	-0,70
OURO	1 739,88	-5,35	-69,38	T-NOTE 10Y	2,426	-3,31	30,40
TRIGO	627,00	0,00	-42,75	T-NOTE 2Y	0,765	0,19	5,00
LICENÇA C02	42,83	0,86	4,87	GILT 10Y	1,065	-2,21	19,20



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1926	0,29%	-1,71%	1,1950	1,1974	1,2028
EUR/GBP	0,86233	-0,55%	0,34%	0,8638	0,8653	0,8686
EUR/JPY	129,77	-0,18%	-1,36%	129,77	129,77	129,77
EUR/CHF	1,1023	0,35%	-1,17%	1,1017	1,1010	1,0999
EUR/BRL	6,5979	-0,87%	0,63%	6,6472	6,7245	6,9221
EUR/PLN	4,5938	0,46%	-2,11%	4,6002	4,6074	4,6267



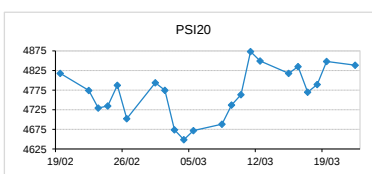
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1926	0,8623	129,77	1,1023	10,1567	7,4362	1,4946	1,54072	6,5979	10,1309
USD	0,8388	-	0,7228	108,765	0,9247	8,5214	6,2375	1,2528	1,2914	5,5155	8,5064

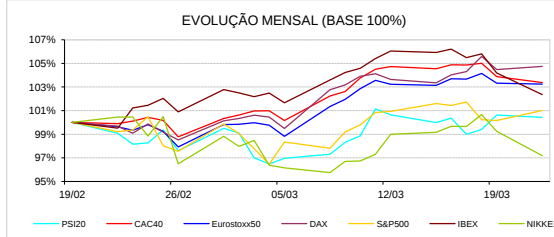
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,990	-2,68	16,09
BCP	0,114	-2,32	-7,55
CORT. AMORIM	10,340	-0,58	-10,86
CTT	3,180	3,92	35,32
EDP	4,934	0,84	-4,31
EDP R	17,360	0,58	-23,86
GALP	10,075	-1,71	15,09
IBERSOL	5,340	0,75	-1,11
J MARTINS	13,240	0,11	-4,20
MOTA ENGIL	1,424	-2,33	4,40
NAVIGATOR	2,760	-1,08	10,49
NOVABASE	3,480	0,87	8,41
NOS	3,080	0,00	7,77
PHAROL	0,114	-1,22	-8,81
REN	2,385	-0,42	0,85
SEMAPA	11,800	-0,34	31,11
SONAE SGPS	0,791	1,93	19,50

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	3,92
SONAE SGPS	1,93
NOVABASE	0,87
EDP	0,84
IBERSOL	0,75
PHAROL	-1,22
GALP	-1,71
BCP	-2,32
MOTA ENGIL	-2,33
ALTRI	-2,68



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4 838,76	-0,20%	-1,22%	5 317,89	3 500,02
CAC40	5 968,48	-0,49%	7,51%	6 089,20	3 851,17
ESTX 50 PR	3 833,84	-0,08%	7,92%	3 874,91	2 427,87
XTRA DAX	14 657,21	0,25%	6,84%	14 804,01	8 480,28
S&P 500	3 946,68	0,85%	5,07%	3 983,87	2 191,86
IBEX 35	8 343,50	-1,76%	3,34%	8 740,10	6 148,00
NIKKEI 225	29 174,15	-2,07%	6,30%	30 714,52	16 480,95



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.