

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

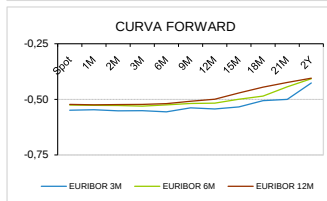
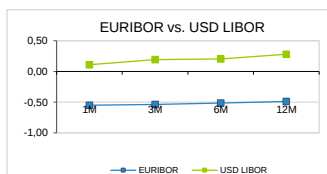
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

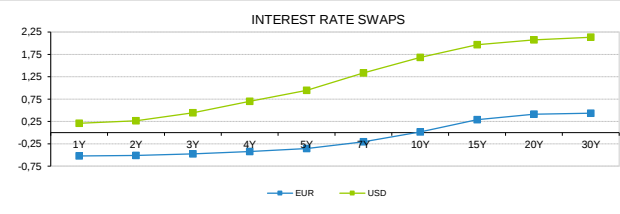
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5500	0	0	1M	0,1091	0	-1	0,0495
3M	-0,5370	0	-1	3M	0,1930	0	0	0,0884
6M	-0,5140	0	0	6M	0,2039	-1	0	0,1093
12M	-0,4890	0	-1	12M	0,2808	0	0	0,1616
								-0,8050
								-0,7590
								-0,7114
								-0,5956

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,5223	0	-3	-0,4998	-0,2607	0,0880	
2Y	-0,5115	0	-5	-0,4522	-0,1781	0,1675	
3Y	-0,4757	0	-6	-0,3884	-0,0900	0,2455	
4Y	-0,4218	1	-6	-0,3153	-0,0060	0,3180	
5Y	-0,3566	1	-6	-0,2341	0,0755	0,3900	
7Y	-0,2050	2	-4	-0,0747	0,2250	0,4985	
10Y	0,0168	3	-2	0,1421	0,3985	0,6135	
15Y	0,2890	3	2	0,3773	0,5459	0,6740	
20Y	0,4120	3	5	0,4677	0,5737	0,6490	
30Y	0,4340	3	8	0,4615	0,5151	0,5505	

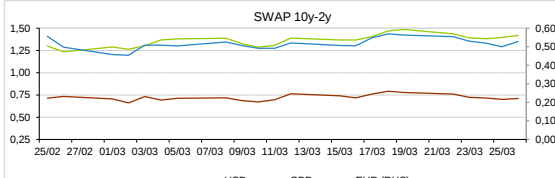
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,75
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2087	0	2	0,3200	1,4550	2,2805
2Y	0,2632	0	3	0,5540	1,7158	2,3380
3Y	0,4450	1	4	0,8672	1,8705	2,3915
4Y	0,7008	1	7	1,1180	2,0065	2,4592
5Y	0,9447	2	12	1,3320	2,1299	2,4928
7Y	1,3340	2	17	1,6435	2,2562	2,5100
10Y	1,6812	2	21	1,9282	2,3598	2,5661
15Y	1,9673	3	24	2,1309	2,3980	2,5120
20Y	2,0763	3	25	2,1760	2,4109	2,5012
30Y	2,1326	3	25	2,1820	2,3484	2,3820

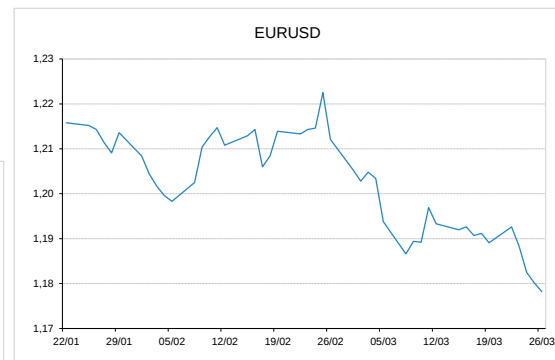
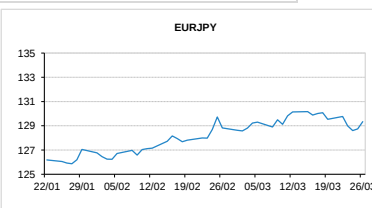
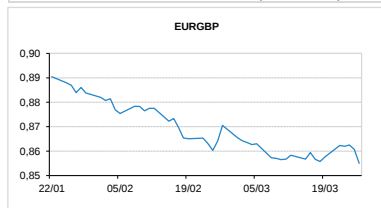


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,55	2,60	0,13	OT 2Y	-0,619	0,02	-5,40
JETFUEL	506,00	-18,88	-49,25	OT 5Y	-0,325	0,01	-12,80
DIESEL	492,50	-18,25	-49,75	OT 10Y	0,172	0,02	-10,70
COBRE	8.799,00	-198,00	-633,00	BUND 10Y	-1,279	3,17	-6,40
ZINCO	2.759,25	-29,80	-125,75	SCHATZ 2Y	-2,785	0,00	-2,70
OURO	1.732,70	5,01	-1,34	T-NOTE 10Y	2,396	2,54	20,90
TRIGO	617,25	4,75	-43,00	T-NOTE 2Y	0,744	0,37	2,20
LICENÇA C02	41,73	1,38	4,45	GILT 10Y	-2,485	1,92	0,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1782	-0,17%	-2,80%	1,1805	1,1829	1,1883
EUR/GBP	0,85503	0,66%	1,81%	0,8565	0,8580	0,8612
EUR/JPY	129,34	-0,46%	-0,39%	129,34	129,34	129,34
EUR/CHF	1,1082	-0,22%	-0,99%	1,1075	1,1069	1,1058
EUR/BRL	6,7338	-1,32%	0,40%	6,7871	6,8681	7,0736
EUR/PLN	4,6389	-0,07%	-2,52%	4,6452	4,6524	4,6717



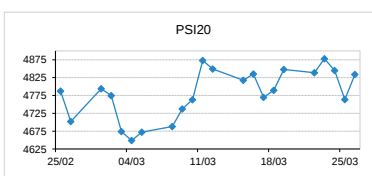
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1782	0,8550	129,34	1,1082	10,1961	7,4360	1,4841	1,54615	6,7338	10,1151
USD	0,8482	-	0,7253	109,685	0,9406	8,6542	6,3073	1,2581	1,3116	5,7123	8,5947

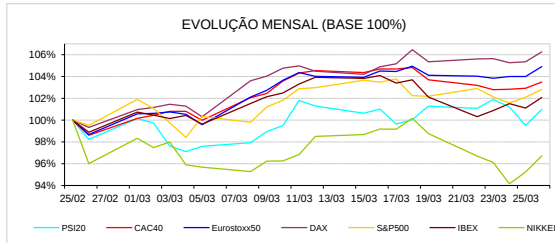
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,865	0,34	13,66
BCP	0,116	1,39	-5,60
CORT. AMORIM	10,120	-0,98	-12,76
CTT	3,300	2,96	40,43
EDP	4,850	0,06	-5,93
EDP R	17,140	2,51	-24,82
GALP	10,050	3,54	14,80
IBERSOL	5,140	-1,53	-4,81
J MARTINS	13,515	1,81	-2,21
MOTA ENGIL	1,406	1,44	3,08
NAVIGATOR	2,736	2,17	9,53
NOVABASE	3,650	-0,27	13,71
NOS	3,104	2,11	8,61
PHAROL	0,117	2,10	-6,57
REN	2,365	0,21	0,00
SEMAPA	11,860	0,85	31,78
SONAE SGPS	0,788	0,83	19,12

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
GALP	3,54
CTT	2,96
EDP R	2,51
NAVIGATOR	2,17
NOS	2,11
NOVABASE	-0,27
CORT. AMORIM	-0,98
IBERSOL	-1,53



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.834,17	1,48%	-1,31%	5.317,89	3.820,68
CAC40	5.985,87	0,56%	7,83%	6.089,20	4.142,28
ESTX 50 PR	3.865,68	0,87%	8,81%	3.874,91	2.626,10
XTRA DAX	14.747,20	0,86%	7,50%	14.804,01	9.337,02
S&P 500	3.935,95	0,69%	4,81%	3.983,87	2.447,49
IBEX 35	8.489,40	0,95%	5,15%	8.740,10	6.329,50
NIKKEI 225	29.176,70	1,56%	6,31%	30.714,52	17.646,50



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.