

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

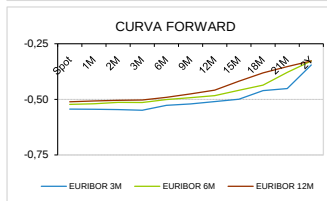
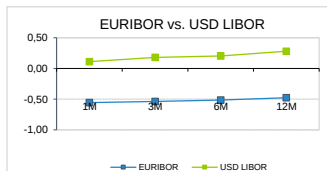
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

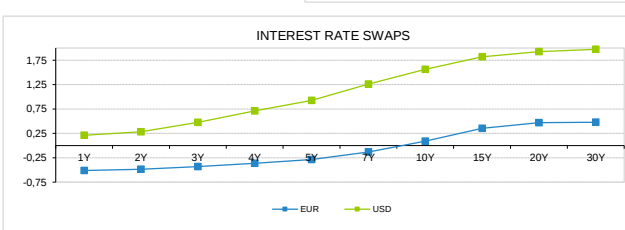
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5560	0	-1	1M	0,1110	0	0	0,0460
3M	-0,5380	0	0	3M	0,1814	1	-2	0,0886
6M	-0,5140	0	0	6M	0,2041	-1	0	0,1106
12M	-0,4770	0	1	12M	0,2809	0	0	0,1590
								-0,7966
								-0,7450
								-0,7060
								-0,5916

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5114	0	1	-0,4575	-0,1617	0,1780
2Y	-0,4848	0	3	-0,3920	-0,0740	0,2580
3Y	-0,4320	0	4	-0,3150	0,0110	0,3320
4Y	-0,3642	1	5	-0,2320	0,0930	0,4030
5Y	-0,2876	1	6	-0,1500	0,1705	0,4640
7Y	-0,1320	1	7	0,0100	0,3115	0,5710
10Y	0,0883	0	6	0,2190	0,4760	0,6765
15Y	0,3525	0	6	0,4461	0,6140	0,7295
20Y	0,4689	0	5	0,5300	0,6350	0,6980
30Y	0,4780	0	4	0,5100	0,5630	0,5920

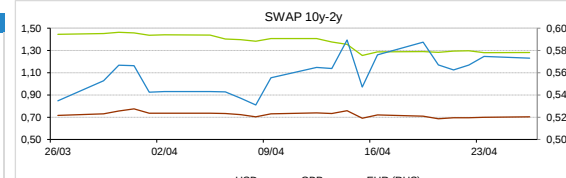
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,75
Austrália	0,10
Índia	3,50



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2109	0	0	0,3513	1,4150	2,0610
2Y	0,2825	0	2	0,5980	1,6190	2,1110
3Y	0,4761	1	3	0,8650	1,7271	2,1680
4Y	0,7112	1	0	1,0937	1,8490	2,2110
5Y	0,9255	1	-4	1,2820	1,9245	2,2621
7Y	1,2606	1	-10	1,5440	2,0659	2,2810
10Y	1,5635	1	-15	1,7881	2,1630	2,2995
15Y	1,8205	0	-17	1,9425	2,1950	2,3333
20Y	1,9257	0	-17	2,0210	2,2213	2,2680
30Y	1,9731	0	-18	2,0170	2,1571	2,1831

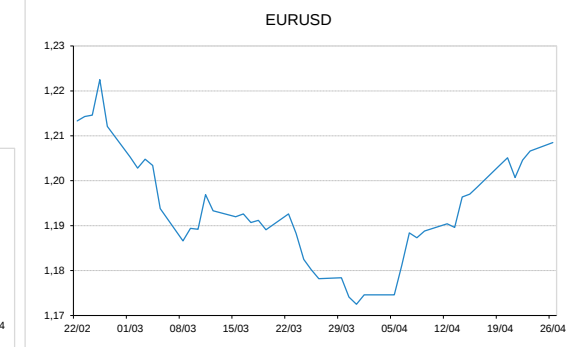
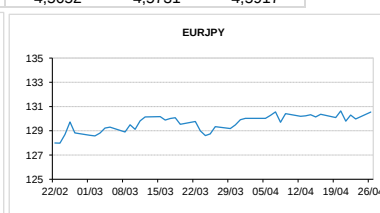


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	65,59	-0,52	1,16	OT 2Y	-0,548	0,00	8,80
JETFUEL	546,24	3,98	45,74	OT 5Y	-0,248	0,00	8,80
DIESEL	528,75	4,25	41,00	OT 10Y	0,404	0,00	25,50
COBRE	9.551,50	150,50	571,50	BUND 10Y	-0,779	0,28	12,40
ZINCO	2.841,50	30,00	8,50	SCHATZ 2Y	-0,041	0,46	3,20
OURO	1.779,18	1,97	46,66	T-NOTE 10Y	2,350	0,74	-2,10
TRIGO	737,00	24,75	127,75	T-NOTE 2Y	0,768	1,11	2,70
LICENÇA C02	47,28	0,33	5,55	GILT 10Y	0,996	0,82	1,20



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2085	0,16%	2,57%	1,2108	1,2132	1,2186
EUR/GBP	0,86975	-0,08%	-1,69%	0,8712	0,8727	0,8759
EUR/JPY	130,54	-0,43%	-0,92%	130,54	130,54	130,54
EUR/CHF	1,1052	0,01%	0,21%	1,1046	1,1040	1,1028
EUR/BRL	6,5861	0,58%	3,08%	6,6468	6,7256	6,9163
EUR/PLN	4,5591	-0,08%	1,80%	4,5652	4,5731	4,5917



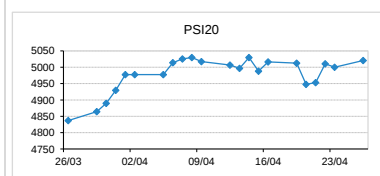
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2085	0,8698	130,54	1,1052	10,1296	7,4361	1,4973	1,54885	6,5861	10,0108
USD	0,8276	-	0,7197	108,035	0,9141	8,3834	6,1540	1,2391	1,2803	5,4522	8,2846

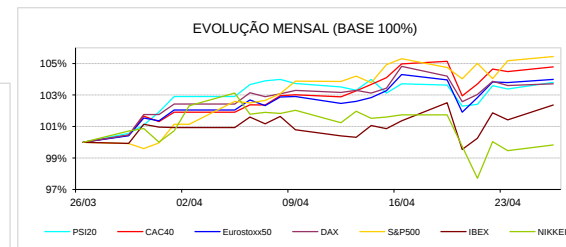
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,685	1,44	29,55
BCP	0,115	2,40	-6,41
CORT. AMORIM	9,990	-1,48	-13,88
CTT	3,745	3,17	59,36
EDP	4,823	-1,53	-6,46
EDP R	20,520	-0,97	-10,00
GALP	9,502	1,67	8,54
IBERSOL	6,200	1,64	14,81
J MARTINS	14,170	-0,14	2,53
MOTA ENGIL	1,425	-0,21	4,47
NAVIGATOR	2,872	1,06	14,97
NOVABASE	4,020	2,55	25,23
NOS	3,140	1,62	9,87
PHAROL	0,105	0,38	-16,03
REN	2,440	0,21	3,17
SEMAPA	12,160	0,66	35,11
SONAE SGPS	0,785	0,51	18,59

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	3,17
NOVABASE	2,55
BCP	2,40
GALP	1,67
IBERSOL	1,64
J MARTINS	-0,14
MOTA ENGIL	-0,21
EDP R	-0,97
CORT. AMORIM	-1,48
EDP	-1,53



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.020,86	0,41%	2,50%	5.317,89	3.820,68
CAC40	6.275,52	0,28%	13,04%	6.319,08	4.194,58
ESTX 50 PR	4.020,87	0,19%	13,18%	4.040,88	2.708,07
XTRA DAX	15.296,34	0,11%	11,50%	15.501,84	10.160,89
S&P 500	4.190,96	0,26%	11,58%	4.194,17	2.766,64
IBEX 35	8.699,60	0,94%	7,75%	8.741,40	6.329,50
NIKKEI 225	29.126,23	0,36%	6,13%	30.714,52	19.410,18



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.