

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

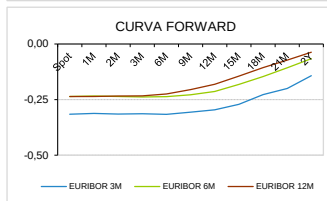
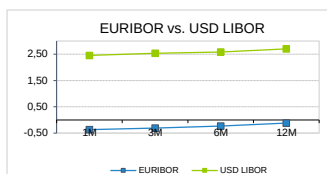
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

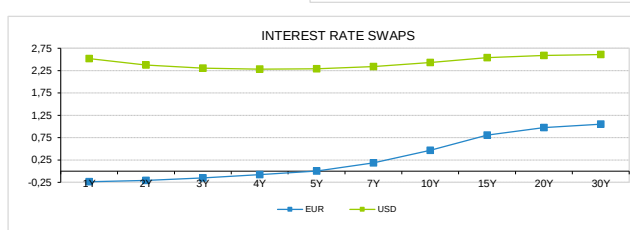
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4534	0	-3	0,7315
3M	-0,3090	0	0	3M	2,5353	-1	-5	0,8096
6M	-0,2310	0	0	6M	2,5816	0	-5	0,9143
12M	-0,1180	0	-1	12M	2,7021	-1	-5	1,0600
								-0,5124

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2362	0	0	-0,1824	0,1440	0,5540
2Y	-0,2090	0	-1	-0,1086	0,2460	0,6640
3Y	-0,1520	0	-2	-0,0260	0,3574	0,7700
4Y	-0,0790	-1	-3	0,0680	0,4550	0,8690
5Y	0,0030	-1	-4	0,1650	0,5595	0,9580
7Y	0,1860	-1	-6	0,3665	0,7495	1,1000
10Y	0,4650	-1	-6	0,6410	0,9714	1,2505
15Y	0,8050	-1	-7	0,9399	1,1669	1,3515
20Y	0,9750	-2	-6	1,0786	1,2348	1,3520
30Y	1,0510	-2	-6	1,1235	1,2165	1,2835

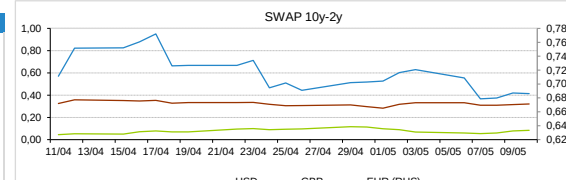
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5170	-1	-6	2,2230	2,1900	2,3970
2Y	2,3740	-1	-7	2,1390	2,2365	2,4490
3Y	2,3040	-1	-7	2,1540	2,2930	2,4815
4Y	2,2820	-1	-7	2,1860	2,3420	2,5489
5Y	2,2910	-2	-6	2,2290	2,3900	2,5891
7Y	2,3400	-2	-6	2,3130	2,4600	2,6075
10Y	2,4320	-2	-6	2,4225	2,5510	2,6650
15Y	2,5410	-2	-6	2,5260	2,6160	2,6795
20Y	2,5890	-2	-6	2,5700	2,6330	2,6740
30Y	2,6090	-3	-6	2,5850	2,6155	2,6550

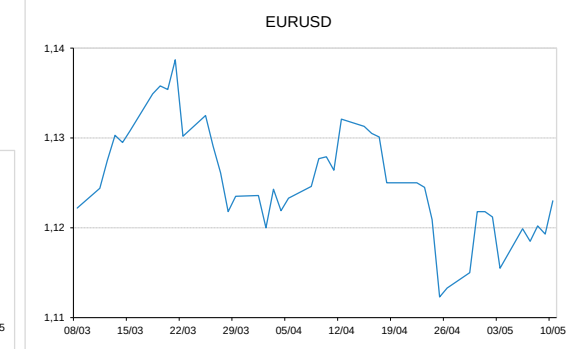
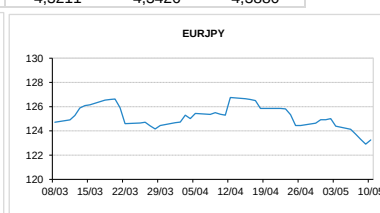
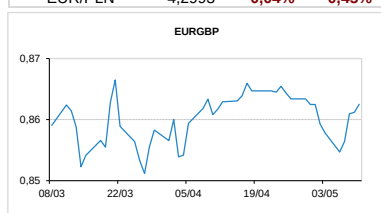


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	70,67	0,28	-0,63	OT 2Y	-0,337	-0,01	-0,20
JETFUEL	666,90	-2,85	5,80	OT 5Y	0,099	0,01	-2,70
DIESEL	635,40	-4,85	5,80	OT 10Y	1,117	0,00	-5,00
COBRE	6.141,00	-46,00	-385,00	BUND 10Y	-0,457	0,29	-2,40
ZINCO	2.697,00	-36,50	-193,00	SCHATZ 2Y	0,007	1,15	-1,80
OURO	1.288,65	4,84	-21,35	T-NOTE 10Y	3,162	-1,93	-3,80
TRIGO	431,00	1,50	-30,50	T-NOTE 2Y	2,615	-3,10	-6,40
LICENÇA C02	25,52	-0,98	-0,61	GILT 10Y	1,052	1,28	3,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,123	0,33%	-0,43%	1,1317	1,1401	1,1566
EUR/GBP	0,8625	-0,15%	-0,19%	0,8652	0,8680	0,8740
EUR/JPY	123,25	-0,28%	1,73%	123,25	123,25	123,25
EUR/CHF	1,1365	0,11%	-0,55%	1,1354	1,1343	1,1321
EUR/BRL	4,4544	-0,60%	-3,19%	4,5242	4,5927	4,7215
EUR/PLN	4,2993	-0,04%	-0,45%	4,3211	4,3426	4,3880



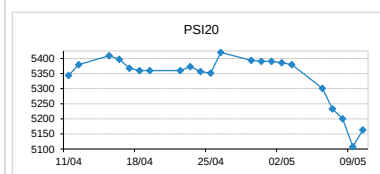
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1230	0,8625	123,25	1,1365	10,8137	7,4661	1,5095	1,60645	4,4544	9,8121
USD	0,8894	-	0,7673	109,595	1,0109	9,6155	6,6399	1,3430	1,4295	3,9682	8,7338

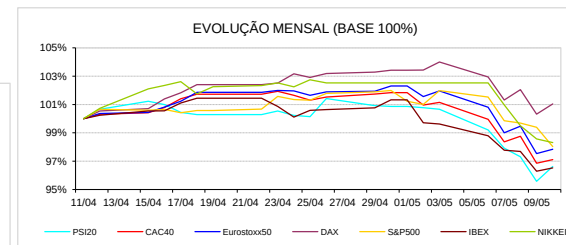
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,430	-1,30	10,86
BCP	0,251	4,62	9,46
CORT. AMORIM	10,340	-0,58	14,89
CTT	2,342	0,77	-20,50
EDP	3,290	2,05	7,90
EDP R	8,540	1,18	9,84
GALP	13,895	0,32	0,72
IBERSOL	7,960	0,51	0,76
J MARTINS	13,795	0,33	33,41
MOTA ENGIL	2,140	-0,56	32,92
NAVIGATOR	3,558	-1,22	-1,17
NOS	5,760	0,88	8,78
NOVABASE	2,510	-0,40	24,26
PHAROL	0,160	2,31	-2,21
RAMADA	7,700	0,52	2,67
REN	13,480	0,90	2,90
SEMAPA	0,864	0,47	1,77
SONAE CAP.	0,951	0,80	17,35
SONAE SGPS	7,700	0,52	2,67

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	4,62
PHAROL	2,31
EDP	2,05
EDP R	1,18
REN	0,90
NOVABASE	-0,40
MOTA ENGIL	-0,56
CORT. AMORIM	-0,58
NAVIGATOR	-1,22
ALTRI	-1,30



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.163,75	1,09%	9,14%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.327,44	0,27%	12,61%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.361,05	0,31%	11,98%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	12.059,83	0,72%	14,21%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.830,19	-1,37%	12,95%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.117,50	0,25%	6,76%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.344,92	-0,27%	6,65%	24.448,07	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.