

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

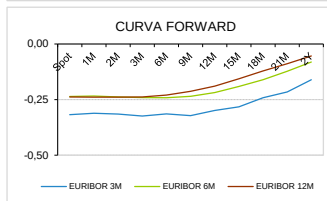
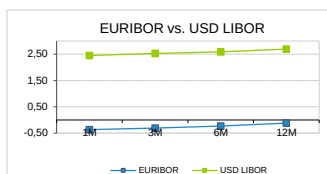
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

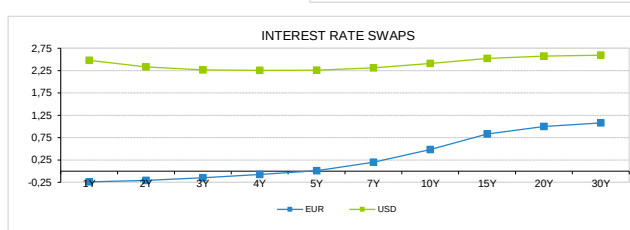
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,3660	0	0	1M	2,4490	0	-3	0,7311
3M	-0,3110	0	0	3M	2,5279	-1	-8	0,8050
6M	-0,2310	0	0	6M	2,5870	1	-4	0,9128
12M	-0,1180	0	-1	12M	2,6934	-1	-5	1,0591
								-0,7934
								-0,7116
								-0,6536
								-0,5172

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2385	0	-1	-0,1904	0,1725	0,5258
2Y	-0,2070	0	-1	-0,1220	0,2003	0,6277
3Y	-0,1490	0	-1	-0,0398	0,3396	0,7360
4Y	-0,0750	0	-2	0,0506	0,4153	0,8308
5Y	0,0110	1	-2	0,1450	0,5217	0,9135
7Y	0,2000	1	-2	0,3419	0,7112	1,0576
10Y	0,4840	2	-3	0,6084	0,9245	1,2030
15Y	0,8300	3	-2	0,8992	1,1176	1,3040
20Y	0,9990	2	-2	1,0340	1,1868	1,3030
30Y	1,0790	3	-2	1,0791	1,1700	1,2349

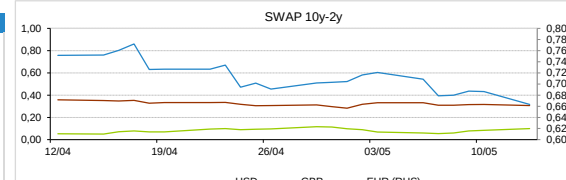
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,4790	-1	-9	2,1570	2,3272	2,3540
2Y	2,3320	-1	-9	2,0570	2,1870	2,5974
3Y	2,2660	-1	-7	2,0780	2,2315	2,4395
4Y	2,2550	-3	-9	2,1175	2,2825	2,4870
5Y	2,2590	-1	-6	2,1610	2,3330	2,5471
7Y	2,3130	-1	-5	2,2505	2,4160	2,5730
10Y	2,4100	-1	-5	2,3919	2,5045	2,6210
15Y	2,5220	-1	-5	2,4800	2,5705	2,6460
20Y	2,5730	-1	-6	2,5200	2,5890	2,6410
30Y	2,5940	-1	-6	2,5395	2,5810	2,6120

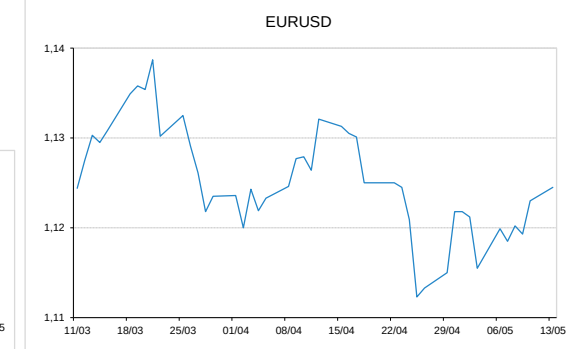
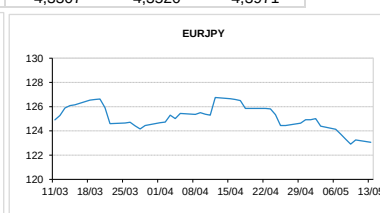


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	70,02	-0,60	-1,04	OT 2Y	-0,330	0,01	3,00
JETFUEL	674,50	2,50	7,56	OT 5Y	0,119	0,02	2,70
DIESEL	643,75	2,75	6,00	OT 10Y	1,156	0,04	2,40
COBRE	6.146,00	24,00	-338,00	BUND 10Y	-0,485	-2,51	-7,30
ZINCO	2.669,50	25,50	-217,00	SCHATZ 2Y	-0,007	-0,92	-4,40
OURO	1.299,97	13,93	9,62	T-NOTE 10Y	3,126	-5,47	-9,90
TRIGO	432,75	8,00	-35,75	T-NOTE 2Y	2,565	-6,78	-14,50
LICENÇA C02	25,03	-0,59	-1,55	GILT 10Y	1,016	-3,30	-5,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1245	0,13%	-0,60%	1,1332	1,1415	1,1577
EUR/GBP	0,8635	-0,12%	-0,05%	0,8662	0,8690	0,8750
EUR/JPY	123,06	0,15%	2,93%	123,06	123,06	123,06
EUR/CHF	1,1304	0,56%	0,41%	1,1293	1,1282	1,1261
EUR/BRL	4,474	-0,63%	-2,19%	4,5438	4,6123	4,7421
EUR/PLN	4,3083	-0,29%	-0,79%	4,3307	4,3520	4,3971



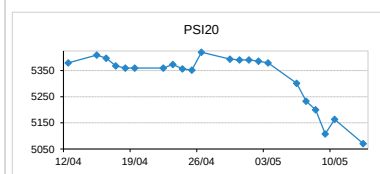
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1245	0,8635	123,06	1,1304	10,8135	7,4676	1,5142	1,61822	4,4740	9,8418
USD	0,8894	-	0,7699	109,12	1,0061	9,6152	6,6417	1,3445	1,4377	3,9956	8,7421

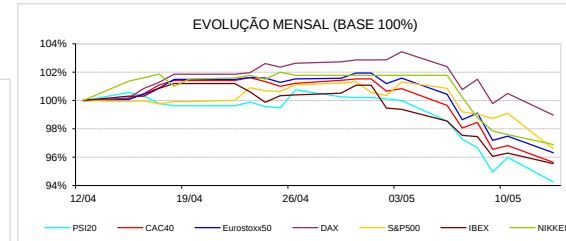
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,255	-2,72	7,84
BCP	0,246	-2,15	7,10
CORT. AMORIM	10,120	-2,13	12,44
CTT	2,276	-2,82	-22,74
EDP	3,157	-4,04	3,54
EDP R	8,640	1,17	11,13
GALP	13,710	-1,33	-0,62
IBERSOL	8,080	1,51	2,28
J MARTINS	13,530	-1,92	30,85
MOTA ENGIL	2,044	-4,49	26,96
NAVIGATOR	3,448	-3,09	-4,22
NOS	5,720	-0,69	8,03
NOVABASE	2,510	0,00	24,26
PHAROL	0,156	-2,26	-4,41
RAMADA	7,740	0,52	3,20
REN	13,100	-2,82	0,00
SEMAPA	0,870	0,69	2,47
SONAE CAP.	0,925	-2,74	14,14
SONAE SGPS	7,740	0,52	3,20

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	1,51
EDP R	1,17
SEMAPA	0,69
RAMADA	0,52
RAMADA	0,52
CTT	-2,82
REN	-2,82
NAVIGATOR	-3,09
EDP	-4,04
MOTA ENGIL	-4,49



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.070,37	-1,81%	7,16%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.262,57	-1,22%	11,24%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.320,78	-1,20%	10,64%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.876,65	-1,52%	12,48%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.808,12	-2,54%	12,02%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.046,80	-0,78%	5,94%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.191,28	-0,72%	5,88%	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.