

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

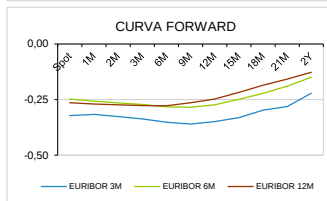
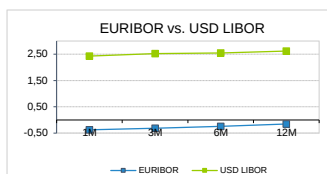
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

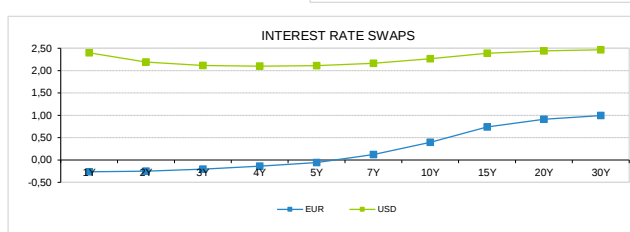
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,3740	0	-1	1M	2,4281	0	-6	0,7300
3M	-0,3150	0	-1	3M	2,5249	0	-6	0,7956
6M	-0,2420	0	-1	6M	2,5486	-1	-7	0,8936
12M	-0,1530	-1	-4	12M	2,6190	-3	-11	1,0220
								-0,5212

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2640	0	-3	-0,2490	0,0400	0,4310
2Y	-0,2500	0	-5	-0,2012	0,1255	0,5310
3Y	-0,2040	0	-7	-0,1115	0,2340	0,6310
4Y	-0,1370	0	-8	-0,0255	0,3280	0,7250
5Y	-0,0560	0	-8	0,0655	0,4286	0,8115
7Y	0,1210	-1	-9	0,2545	0,6140	0,9580
10Y	0,3940	-1	-10	0,5190	0,8347	1,1130
15Y	0,7380	-1	-10	0,8174	1,0371	1,2180
20Y	0,9110	-1	-10	0,9545	1,1069	1,2240
30Y	0,9940	-2	-10	1,0064	1,0965	1,1618

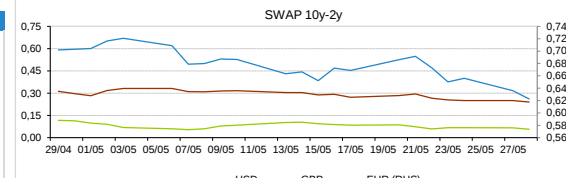
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,3980	-2	-15	1,9438	1,9650	2,1895
2Y	2,1900	-3	-22	1,8990	2,0275	2,2370
3Y	2,1150	-3	-24	1,9215	2,0775	2,2810
4Y	2,0990	-3	-24	1,9640	2,1280	2,3235
5Y	2,1100	-2	-24	2,0070	2,1750	2,3844
7Y	2,1640	-2	-24	2,0930	2,2610	2,4225
10Y	2,2640	-2	-24	2,2130	2,3550	2,4760
15Y	2,3860	-2	-24	2,3300	2,4250	2,5040
20Y	2,4400	-2	-24	2,3780	2,4470	2,5010
30Y	2,4660	-2	-24	2,4000	2,4460	2,4810

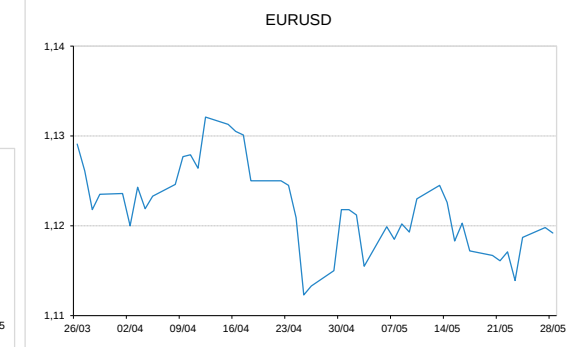
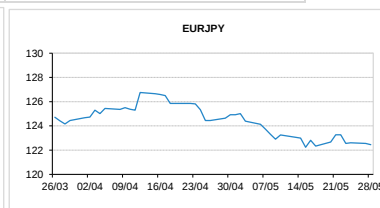
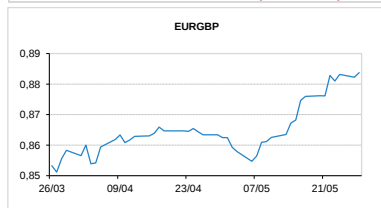


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	69,89	-0,22	-1,74	OT 2Y	-0,400	-0,01	-5,00
JETFUEL	653,66	13,75	-5,26	OT 5Y	-0,004	-0,02	-10,60
DIESEL	623,41	13,25	-4,76	OT 10Y	0,920	-0,04	-21,00
COBRE	5.962,50	29,00	-493,00	BUND 10Y	-0,571	-1,21	-14,20
ZINCO	2.664,00	49,00	-104,50	SCHATZ 2Y	-0,025	0,23	-4,80
OURO	1.279,99	-5,16	-8,06	T-NOTE 10Y	3,042	-4,63	-17,10
TRIGO	504,50	15,00	62,00	T-NOTE 2Y	2,543	-3,87	-11,40
LICENÇA C02	25,47	-0,12	-0,38	GILT 10Y	0,841	-2,97	-22,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1192	-0,05%	0,38%	1,1279	1,1361	1,1521
EUR/GBP	0,88373	-0,17%	-2,30%	0,8864	0,8892	0,8953
EUR/JPY	122,45	0,09%	1,79%	122,45	122,45	122,45
EUR/CHF	1,1277	-0,35%	1,11%	1,1266	1,1255	1,1234
EUR/BRL	4,4979	0,58%	-1,92%	4,5692	4,6350	4,7619
EUR/PLN	4,2947	-0,13%	-0,05%	4,3168	4,3387	4,3846



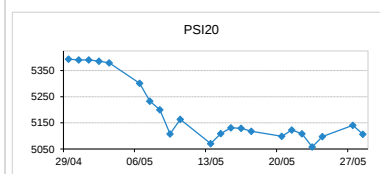
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1192	0,8837	122,45	1,1277	10,6946	7,4688	1,5065	1,61304	4,4979	9,7246
USD	0,8949	-	0,7893	109,545	1,0083	9,5719	6,6816	1,3476	1,4431	4,0283	8,6981

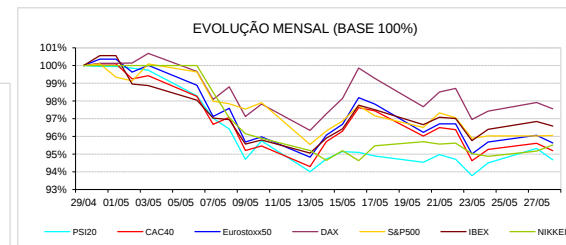
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,180	-0,80	6,55
BCP	0,257	0,16	12,07
CORT. AMORIM	10,400	1,76	15,56
CTT	2,316	0,78	-21,38
EDP	3,357	-0,42	10,10
EDP R	8,740	-0,79	12,41
GALP	13,860	-1,63	0,47
IBERSOL	8,160	1,24	3,29
J MARTINS	13,890	-0,96	34,33
MOTA ENGIL	2,108	-0,28	30,93
NAVIGATOR	3,308	-1,49	-8,11
NOS	5,510	-0,09	4,06
NOVABASE	2,400	-0,83	18,81
PHAROL	0,148	-0,67	-9,31
RAMADA	7,700	0,52	2,67
REN	12,720	-0,16	-2,90
SEMAPA	0,801	-1,35	-5,65
SONAE CAP.	0,891	2,31	9,94
SONAE SGPS	7,700	0,52	2,67

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
SONAE CAP.	2,31
CORT. AMORIM	1,76
IBERSOL	1,24
CTT	0,78
RAMADA	0,52
NOVABASE	-0,83
J MARTINS	-0,96
SEMAPA	-1,35
NAVIGATOR	-1,49
GALP	-1,63



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.106,69	-0,67%	7,93%	5.701,90	4.551,84
CAC40	5.312,69	-0,44%	12,30%	5.601,38	4.555,99
ESTX 50 PR	3.348,86	-0,45%	11,58%	3.540,64	2.908,70
XTRA DAX	12.027,05	-0,37%	13,90%	13.170,05	10.279,20
S&P 500	2.827,10	0,02%	12,76%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.191,80	-0,27%	7,63%	9.985,90	8.286,20
NIKKEI 225	21.260,14	0,37%	6,22%	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.