

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

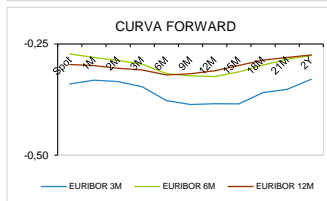
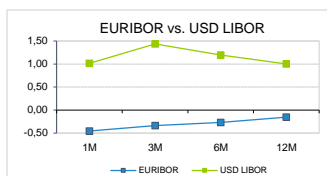
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

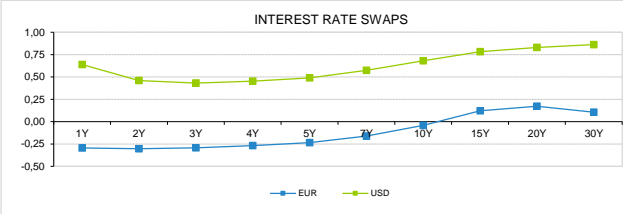
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,4540	1	3	1M	1,0163	2	-50	0,2345
3M	-0,3360	1	10	3M	1,4365	-1	-3	0,5745
6M	-0,2680	1	13	6M	1,1953	2	-20	0,7199
12M	-0,1530	2	17	12M	1,0024	0	-38	0,8336
								-0,4224

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2945	1	16	-0,3144	-0,1977	-0,0375
2Y	-0,3030	1	17	-0,2975	-0,1462	0,0158
3Y	-0,2930	1	17	-0,2606	-0,1098	0,0620
4Y	-0,2690	0	17	-0,2217	-0,0650	0,1050
5Y	-0,2340	0	17	-0,1845	-0,0214	0,1360
7Y	-0,1617	0	17	-0,0998	0,0627	0,2149
10Y	-0,0415	0	16	0,0208	0,1686	0,2915
15Y	0,1213	-2	13	0,1592	0,2427	0,2990
20Y	0,1723	-3	7	0,1847	0,2222	0,2402
30Y	0,1050	-4	0	0,1004	0,1094	0,1084

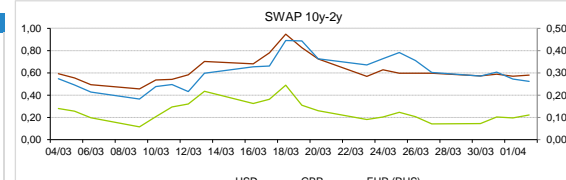
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,75
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,6380	-3	-36	0,3247	0,4920	0,7345
2Y	0,4592	-2	-43	0,3230	0,5772	0,7847
3Y	0,4313	-2	-45	0,3790	0,6257	0,7480
4Y	0,4527	-1	-45	0,4460	0,6771	0,8475
5Y	0,4887	-1	-44	0,5040	0,7186	0,8795
7Y	0,5738	0	-41	0,6079	0,7790	0,9013
10Y	0,6812	0	-39	0,7203	0,8396	0,9232
15Y	0,7818	1	-40	0,7940	0,8834	0,9390
20Y	0,8307	1	-41	0,8348	0,8970	0,9344
30Y	0,8619	2	-41	0,8590	0,8942	0,9090

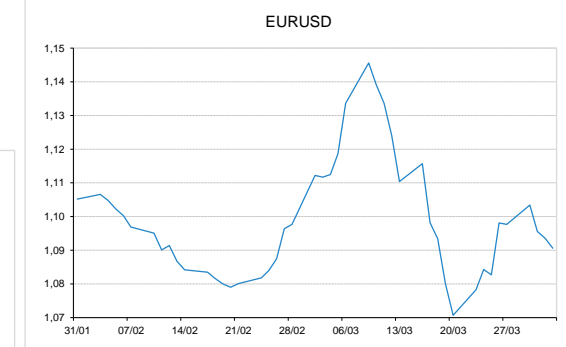
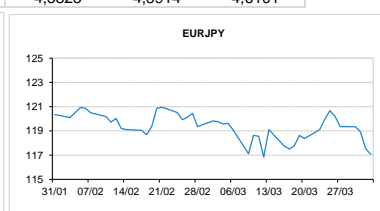


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	30,65	5,91	-21,10	OT 2Y	-0,035	0,01	38,50
JETFUEL	228,13	-2,87	-243,12	OT 5Y	0,415	-0,01	54,00
DIESEL	279,98	-10,02	-174,52	OT 10Y	0,868	-0,02	60,70
COBRE	4.804,50	-151,00	-835,00	BUND 10Y	-0,867	3,50	19,50
ZINCO	1.861,00	-36,75	-157,00	SCHATZ 2Y	-0,041	1,60	14,90
OURO	1.613,17	29,93	14,72	T-NOTE 10Y	1,734	-0,28	-29,80
TRIGO	544,25	-6,00	21,00	T-NOTE 2Y	0,839	-2,04	-39,30
LICENÇA C02	18,16	1,08	-5,36	GILT 10Y	0,290	2,55	-5,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0906	-0,27%	-1,94%	1,0936	1,0962	1,1018
EUR/GBP	0,87738	0,82%	-0,71%	0,8789	0,8807	0,8847
EUR/JPY	117,06	0,42%	2,36%	117,06	117,06	117,06
EUR/CHF	1,0562	0,09%	1,24%	1,0554	1,0546	1,0532
EUR/BRL	5,7172	0,75%	-12,86%	5,7607	5,8001	5,8722
EUR/PLN	4,5666	0,60%	-5,19%	4,5825	4,5914	4,6101



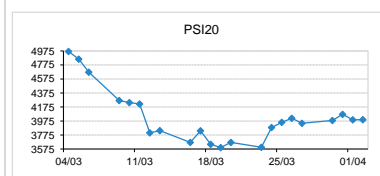
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0906	0,8774	117,06	1,0562	10,9951	7,4675	1,5333	1,79458	5,7172	11,2502
USD	0,9205	-	0,8079	107,965	0,9725	10,1098	6,8732	1,4126	1,6538	5,2644	10,3891

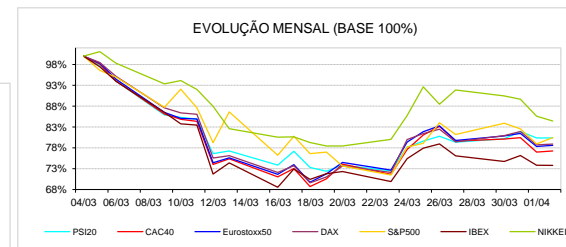
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	3,682	3,25	-35,18
BCP	0,094	-6,00	-53,65
CORT. AMORIM	8,450	1,44	-25,22
CTT	2,290	2,46	-28,21
EDP	3,560	-0,28	-7,87
EDP R	10,320	-1,71	-1,71
GALP	10,485	2,69	-29,63
IBERSOL	4,600	-2,13	-42,50
J MARTINS	15,845	1,02	8,05
MOTA ENGIL	1,074	-1,65	-42,57
NAVIGATOR	2,170	1,97	-37,07
NOS	3,002	-2,15	-37,46
PHAROL	0,065	-3,44	-35,14
RAMADA	2,780	-2,46	-52,40
REN	2,345	1,74	-13,79
SEMAPA	8,190	2,50	-40,31
SONAE CAP.	0,415	-1,89	-44,89
SONAE SGPS	0,591	1,03	-35,05

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
ALTRI	3,25
GALP	2,69
SEMAPA	2,50
CTT	2,46
NAVIGATOR	1,97
IBERSOL	-2,13
NOS	-2,15
RAMADA	-2,46
PHAROL	-3,44
BCP	-6,00



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	3.993,57	0,02%	-23,41%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.220,96	0,33%	-29,39%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.688,49	0,31%	-28,21%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	9.570,82	0,27%	-27,76%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.517,65	1,90%	-22,08%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.574,10	-0,08%	-31,16%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	17.818,72	-1,37%	-24,68%	24.115,95	16.358,19



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.