

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

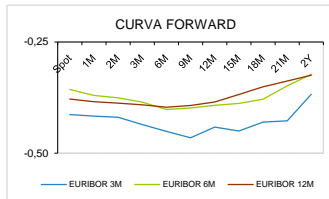
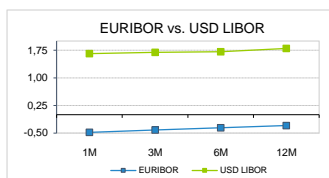
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

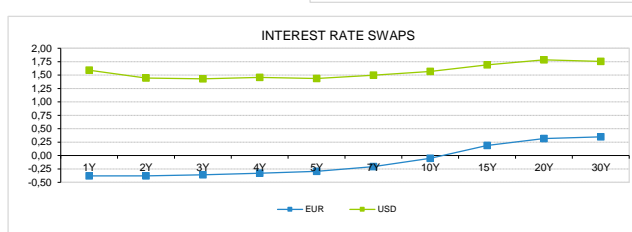
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4800	0	-2	1M	1,6583	0	-1	0,7076	-0,7772
3M	-0,4130	0	-2	3M	1,6918	0	-15	0,7538	-0,7060
6M	-0,3530	1	-2	6M	1,7100	0	-15	0,8064	-0,6624
12M	-0,2940	0	-5	12M	1,7984	0	-16	0,8948	-0,5334

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3783	0	-5	-0,3875	-0,2449	-0,0516
2Y	-0,3790	0	-9	-0,3554	-0,2005	0,0064
3Y	-0,3590	0	-11	-0,3184	-0,1504	0,0698
4Y	-0,3290	0	-14	-0,2775	-0,0964	0,1313
5Y	-0,2940	0	-17	-0,2324	-0,0383	0,1930
7Y	-0,2080	0	-20	-0,1283	0,0799	0,3018
10Y	-0,0510	0	-24	0,0379	0,2420	0,4282
15Y	0,1870	0	-26	0,2590	0,4034	0,5255
20Y	0,3170	0	-27	0,3627	0,4521	0,5231
30Y	0,3480	0	-28	0,3693	0,4086	0,4358

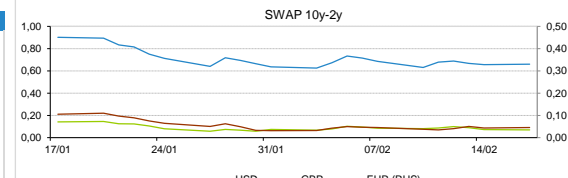
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,75
Índia	4,00



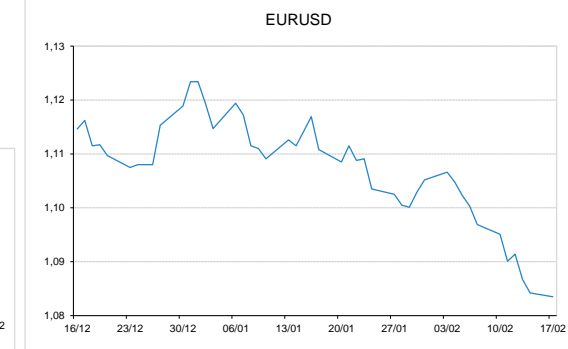
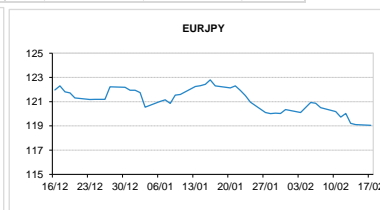
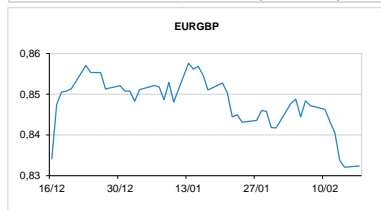
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,5910	-1	-15	1,3516	1,3947	1,4901
2Y	1,4440	-3	-19	1,3370	1,3981	1,5583
3Y	1,4300	-1	-22	1,3516	1,4256	1,6192
4Y	1,4570	3	-19	1,3718	1,4620	1,6265
5Y	1,4370	-1	-21	1,4001	1,5370	1,6632
7Y	1,4980	3	-25	1,4658	1,5640	1,7127
10Y	1,5670	-2	-27	1,5558	1,6642	1,7610
15Y	1,6900	3	-26	1,6563	1,7351	1,8054
20Y	1,7840	6	-12	1,7060	1,7400	1,8015
30Y	1,7540	-1	-28	1,7134	1,7284	1,7471



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	57,36	0,04	-6,67	OT 2Y	-0,435	-0,01	-9,60
JETFUEL	539,23	-0,95	-83,60	OT 5Y	-0,121	0,00	-18,80
DIESEL	519,84	-0,41	-66,41	OT 10Y	0,289	0,00	-22,80
COBRE	5.756,50	-30,00	-542,00	BUND 10Y	-1,027	0,47	-18,30
ZINCO	2.134,75	-29,00	-245,25	SCHATZ 2Y	-0,018	0,23	-5,70
OURO	1.581,94	-2,12	24,70	T-NOTE 10Y	2,482	0,00	-17,80
TRIGO	541,50	-3,25	-28,75	T-NOTE 2Y	1,927	0,95	-10,50
LICENÇA C02	24,96	0,67	-0,48	GILT 10Y	0,558	2,53	-0,10


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0835	-0,06%	-2,46%	1,0894	1,0953	1,1069
EUR/GBP	0,83238	-0,04%	2,24%	0,8350	0,8376	0,8428
EUR/JPY	119,05	0,05%	2,74%	119,05	119,05	119,05
EUR/CHF	1,0632	0,11%	0,99%	1,0624	1,0615	1,0598
EUR/BRL	4,6791	-0,59%	-1,35%	4,7192	4,7614	4,8664
EUR/PLN	4,2588	-0,26%	-0,41%	4,2802	4,3029	4,3516

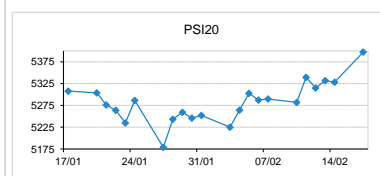

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0835	0,8324	119,05	1,0632	10,5061	7,4704	1,4337	1,61278	4,6791	10,0164
USD	0,9232	-	0,7687	109,95	0,9818	9,7027	6,8976	1,3239	1,4894	4,3213	9,2595

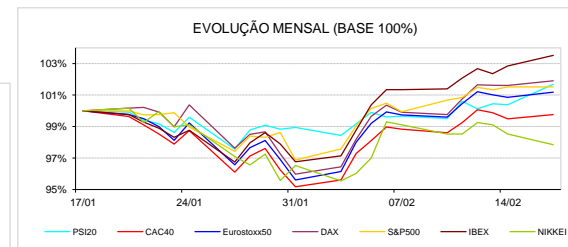
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,680	3,84	0,00
BCP	0,192	1,00	-5,33
CORT. AMORIM	10,800	0,37	-4,42
CTT	2,842	0,35	-10,91
EDP	4,820	2,27	24,74
EDP R	12,820	2,72	22,10
GALP	14,125	1,11	-5,20
IBERSOL	8,600	-1,15	7,50
J MARTINS	17,085	1,30	16,50
MOTA ENGIL	1,670	0,66	-10,70
NAVIGATOR	3,120	0,97	-9,53
NOS	4,414	-0,09	-8,04
PHAROL	0,100	0,10	0,20
RAMADA	5,640	0,00	-3,42
REN	2,780	0,54	2,21
SEMAPA	12,400	1,14	-9,62
SONAE CAP.	0,734	2,80	-2,52
SONAE SGPS	0,843	0,60	-7,42

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	3,84
SONAE CAP.	2,80
EDP R	2,72
EDP	2,27
J MARTINS	1,30
NOS	-0,09
IBERSOL	-1,15



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.397,46	1,30%	3,52%	5.429,32	4.699,20
CAC40	6.085,95	0,27%	1,80%	6.109,81	5.059,50
ESTX 50 PR	3.853,27	0,32%	2,89%	3.854,43	3.175,71
XTRA DAX	13.783,89	0,29%	4,04%	13.795,24	11.018,95
S&P 500	3.380,16	0,18%	4,62%	3.385,09	2.722,27
IBEX 35	10.022,20	0,66%	4,95%	10.022,20	8.409,20
NIKKEI 225	23.523,24	-0,69%	-0,56%	24.115,95	20.110,76



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.