

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

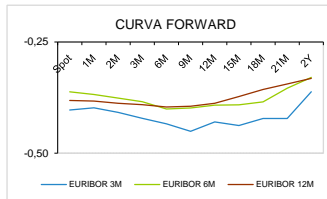
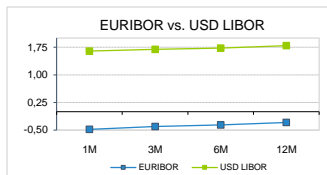
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

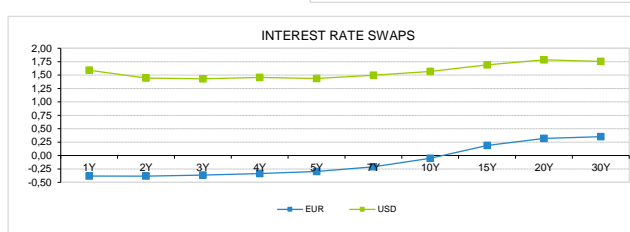
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4800	0	-2	1M	1,6468	-1	-1	0,7091	-0,7778
3M	-0,4030	1	-1	3M	1,6929	0	-13	0,7585	-0,7074
6M	-0,3580	-1	-3	6M	1,7249	1	-12	0,8053	-0,6634
12M	-0,2920	0	-5	12M	1,7928	-1	-13	0,9025	-0,5316

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3815	0	-5	-0,3899	-0,2579	-0,0691
2Y	-0,3840	-1	-8	-0,3597	-0,2149	-0,0145
3Y	-0,3650	-1	-10	-0,3259	-0,1660	0,0466
4Y	-0,3350	-1	-12	-0,2870	-0,1141	0,1106
5Y	-0,2980	0	-14	-0,2433	-0,0577	0,1730
7Y	-0,2100	0	-17	-0,1433	0,0618	0,2820
10Y	-0,0520	0	-20	0,0238	0,2220	0,4090
15Y	0,1870	0	-21	0,2435	0,3864	0,5075
20Y	0,3180	0	-22	0,3480	0,4358	0,5063
30Y	0,3510	0	-23	0,3527	0,3903	0,4173

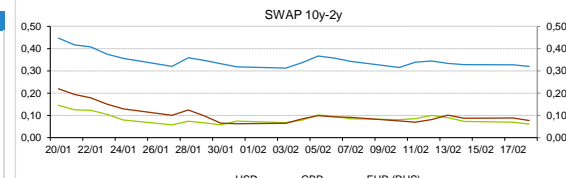
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,75
Índia	4,00



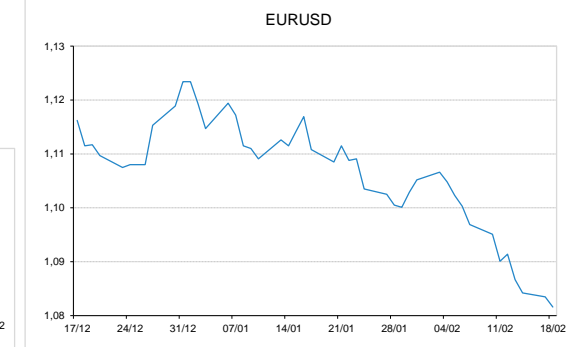
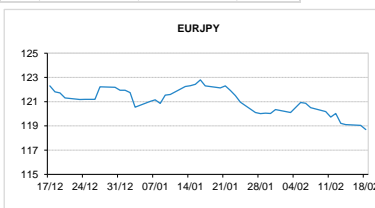
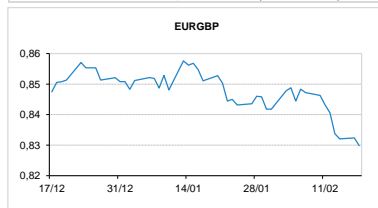
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,5910	-1	-15	1,2914	1,3060	1,4575
2Y	1,4440	-3	-19	1,2852	1,3480	1,5055
3Y	1,4300	-1	-22	1,2790	1,3820	1,5230
4Y	1,4570	3	-19	1,3060	1,4165	1,5500
5Y	1,4370	-1	-21	1,3370	1,4500	1,6064
7Y	1,4980	3	-25	1,3960	1,5135	1,6360
10Y	1,5670	-2	-27	1,4885	1,5895	1,6840
15Y	1,6900	3	-26	1,5840	1,6590	1,7240
20Y	1,7840	6	-12	1,6310	1,6830	1,7240
30Y	1,7540	-1	-28	1,6410	1,6640	1,6790



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	57,00	-0,67	-7,03	OT 2Y	-0,434	0,00	-8,20
JETFUEL	528,10	-9,01	-84,45	OT 5Y	-0,118	0,00	-15,80
DIESEL	508,75	-8,50	-63,25	OT 10Y	0,286	-0,01	-21,30
COBRE	5.822,00	52,00	-461,00	BUND 10Y	-1,036	-0,61	-20,00
ZINCO	2.164,75	23,00	-273,50	SCHATZ 2Y	-0,014	0,69	-5,50
OURO	1.603,82	22,64	46,58	T-NOTE 10Y	2,446	-3,62	-22,50
TRIGO	556,75	15,25	-14,50	T-NOTE 2Y	1,891	-2,67	-14,70
LICENÇA C02	25,10	0,05	-0,34	GILT 10Y	0,522	-3,31	-3,40


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0816	-0,18%	-2,43%	1,0876	1,0934	1,1049
EUR/GBP	0,82985	0,30%	2,76%	0,8324	0,8350	0,8403
EUR/JPY	118,7	0,29%	2,90%	118,70	118,70	118,70
EUR/CHF	1,0613	0,15%	1,21%	1,0605	1,0596	1,0579
EUR/BRL	4,7043	-0,34%	-1,21%	4,7443	4,7872	4,8936
EUR/PLN	4,2708	-0,24%	-0,66%	4,2924	4,3152	4,3641

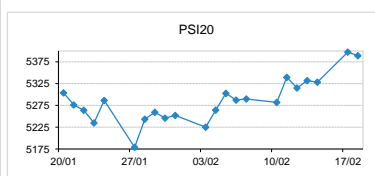

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0816	0,8299	118,70	1,0613	10,5715	7,4701	1,4336	1,61577	4,7043	10,0728
USD	0,9240	-	0,767	109,815	0,9816	9,7647	6,9020	1,3255	1,4933	4,3517	9,3055

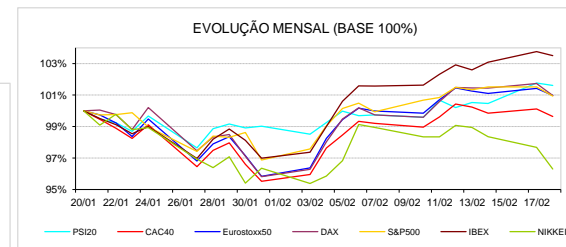
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	5,620	-1,06	-1,06
BCP	0,192	-0,26	-5,57
CORT. AMORIM	10,700	-0,93	-5,31
CTT	2,800	-1,48	-12,23
EDP	4,898	1,62	26,76
EDP R	12,940	0,94	23,24
GALP	14,110	-0,11	-5,30
IBERSOL	8,620	0,23	7,75
J MARTINS	17,005	-0,47	15,96
MOTA ENGIL	1,660	-0,60	-11,23
NAVIGATOR	3,070	-1,60	-10,98
NOS	4,378	-0,82	-8,79
PHAROL	0,099	-0,70	-0,50
RAMADA	5,700	1,06	-2,40
REN	2,770	-0,36	1,84
SEMAPA	12,220	-1,45	-10,93
SONAE CAP.	0,727	-0,95	-3,45
SONAE SGPS	0,827	-1,84	-9,12

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP	1,62
RAMADA	1,06
EDP R	0,94
IBERSOL	0,23
ALTRI	-1,06
SEMAPA	-1,45
CTT	-1,48
NAVIGATOR	-1,60
SONAE SGPS	-1,84



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.389,13	-0,15%	3,36%	5.429,32	4.699,20
CAC40	6.056,82	-0,48%	1,32%	6.109,81	5.137,17
ESTX 50 PR	3.836,06	-0,45%	2,43%	3.854,43	3.223,40
XTRA DAX	13.681,19	-0,75%	3,26%	13.795,24	11.244,52
S&P 500	3.360,51	-0,57%	4,02%	3.385,09	2.722,27
IBEX 35	9.997,00	-0,25%	4,69%	10.041,50	8.409,20
NIKKEI 225	23.193,80	-1,40%	-1,96%	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.