

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

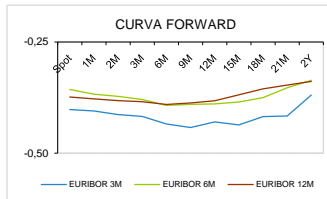
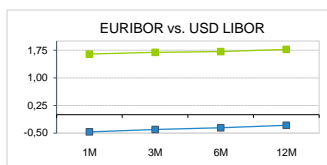
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

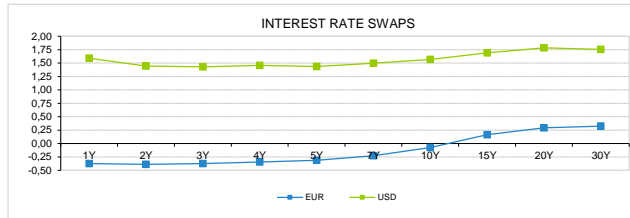
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4670	1	-1	1M	1,6470	0	-1	0,7100	-0,7756
3M	-0,4020	0	-1	3M	1,6946	0	-12	0,7563	-0,7078
6M	-0,3530	1	-2	6M	1,7149	-1	-13	0,8044	-0,6596
12M	-0,2880	0	-5	12M	1,7719	-2	-15	0,8938	-0,5376

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3750	1	-4	-0,3834	-0,2680	-0,0900
2Y	-0,3880	0	-8	-0,3600	-0,2285	-0,0320
3Y	-0,3740	-1	-11	-0,3290	-0,1810	0,0300
4Y	-0,3460	-1	-13	-0,2940	-0,1290	0,0910
5Y	-0,3130	-2	-15	-0,2525	-0,0730	0,1530
7Y	-0,2290	-2	-19	-0,1545	0,0430	0,2610
10Y	-0,0750	-2	-22	0,0080	0,2030	0,3890
15Y	0,1630	-2	-24	0,2280	0,3685	0,4870
20Y	0,2930	-3	-24	0,3317	0,4170	0,4860
30Y	0,3240	-3	-26	0,3355	0,3715	0,3977

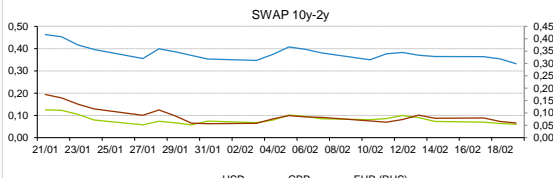
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,75
Índia	4,00



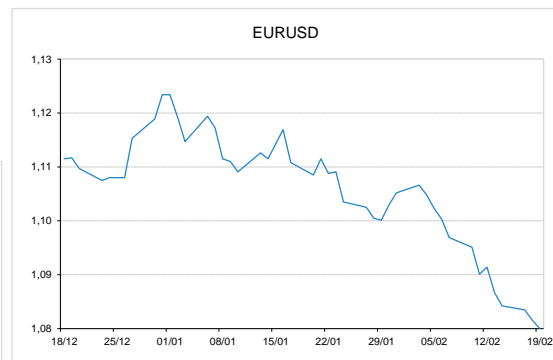
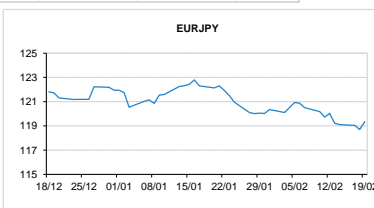
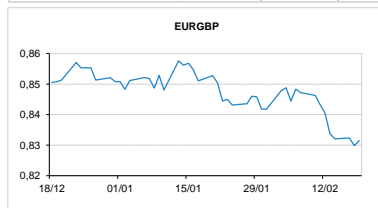
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS			
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	1,5910	-1	-15	1,3254	1,3165	1,4765	
2Y	1,4440	-3	-19	1,3183	1,3690	1,5273	
3Y	1,4300	-1	-22	1,3270	1,4181	1,5180	
4Y	1,4570	3	-19	1,3340	1,4355	1,5951	
5Y	1,4370	-1	-21	1,3610	1,4510	1,6274	
7Y	1,4980	3	-25	1,4374	1,5150	1,6755	
10Y	1,5670	-2	-27	1,5100	1,5870	1,6795	
15Y	1,6900	3	-26	1,5840	1,6960	1,7618	
20Y	1,7840	6	-12	1,6540	1,6825	1,7400	
30Y	1,7540	-1	-28	1,6746	1,6929	1,6845	



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	59,21	1,46	-4,82	OT 2Y	-0,443	-0,01	-8,70
JETFUEL	528,10	-9,01	-84,45	OT 5Y	-0,127	-0,01	-16,00
DIESEL	508,75	-8,50	-63,25	OT 10Y	0,274	-0,01	-21,60
COBRE	5.765,00	-39,00	-500,00	BUND 10Y	-1,042	-0,68	-20,20
ZINCO	2.138,50	-26,25	-299,75	SCHATZ 2Y	-0,014	0,23	-6,00
OURO	1.606,61	5,02	49,37	T-NOTE 10Y	2,471	1,05	-20,00
TRIGO	556,50	-8,50	-14,75	T-NOTE 2Y	1,918	1,52	-12,00
LICENÇA C02	25,57	0,43	0,13	GILT 10Y	0,515	-1,31	-5,30


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,08	-0,15%	-2,57%	1,0859	1,0918	1,1033
EUR/GBP	0,83148	-0,20%	2,56%	0,8341	0,8367	0,8419
EUR/JPY	119,35	-0,54%	2,34%	119,35	119,35	119,35
EUR/CHF	1,0621	-0,06%	1,14%	1,0612	1,0603	1,0585
EUR/BRL	4,7226	-0,26%	-1,59%	4,7621	4,8051	4,9123
EUR/PLN	4,2698	-0,01%	-0,63%	4,2914	4,3144	4,3633

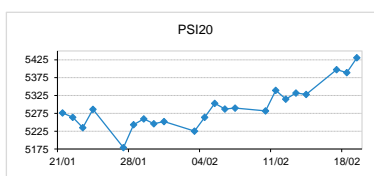

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0800	0,8315	119,35	1,0621	10,5837	7,4686	1,4281	1,6174	4,7226	10,0158
USD	0,9266	-	0,7722	110,945	0,9835	9,7952	6,9199	1,3239	1,4987	4,3738	9,2792

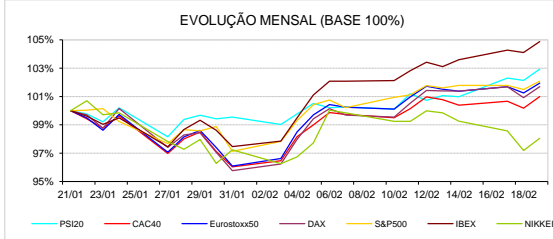
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	5,655	0,62	-0,44
BCP	0,191	-0,16	-5,72
CORT. AMORIM	10,660	-0,37	-5,66
CTT	2,762	-1,36	-13,42
EDP	4,951	1,08	28,13
EDP R	12,960	0,15	23,43
GALP	14,560	3,19	-2,28
IBERSOL	8,580	-0,46	7,25
J MARTINS	17,190	1,09	17,22
MOTA ENGIL	1,662	0,12	-11,12
NAVIGATOR	3,082	0,39	-10,63
NOS	4,442	1,46	-7,46
PHAROL	0,098	-0,81	-1,31
RAMADA	5,720	0,35	-2,05
REN	2,780	0,36	2,21
SEMAPA	12,080	-1,15	-11,95
SONAE CAP.	0,735	1,10	-2,39
SONAE SGPS	0,819	-1,03	-10,05

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
GALP	3,19
NOS	1,46
SONAE CAP.	1,10
J MARTINS	1,09
EDP	1,08
IBERSOL	-0,46
PHAROL	-0,81
SONAE SGPS	-1,03
SEMAPA	-1,15
CTT	-1,36



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.430,97	0,78%	4,16%	5.440,88	4.699,20
CAC40	6.106,17	0,81%	2,14%	6.111,41	5.137,17
ESTX 50 PR	3.862,86	0,69%	3,14%	3.864,72	3.223,40
XTRA DAX	13.785,93	0,77%	4,05%	13.795,24	11.244,52
S&P 500	3.390,03	0,59%	4,93%	3.391,20	2.722,27
IBEX 35	10.080,20	0,74%	5,56%	10.100,20	8.409,20
NIKKEI 225	23.400,70	0,89%	-1,08%	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.