

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

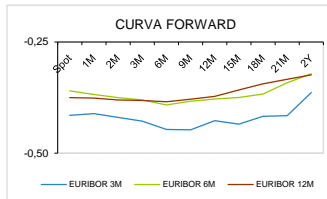
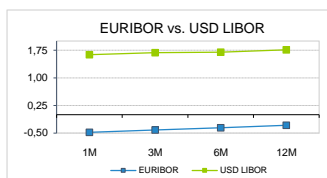
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

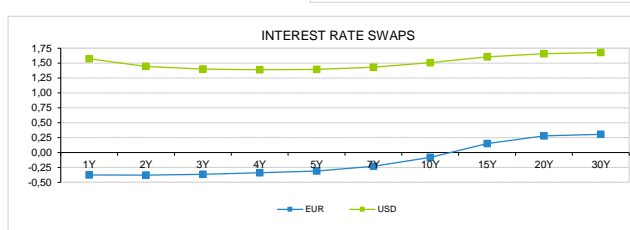
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4780	1	-1	1M	1,6289	-1	-2	0,7129	-0,7842
3M	-0,4150	-1	-2	3M	1,6828	-1	-12	0,7510	-0,7120
6M	-0,3560	0	-2	6M	1,6956	0	-13	0,8038	-0,6712
12M	-0,2870	1	-4	12M	1,7618	-1	-16	0,8908	-0,5464

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3746	0	-4	-0,3721	-0,2610	-0,1020
2Y	-0,3790	0	-8	-0,3479	-0,2250	-0,0519
3Y	-0,3650	0	-10	-0,3206	-0,1790	0,0012
4Y	-0,3400	0	-13	-0,2878	-0,1382	0,0615
5Y	-0,3090	0	-16	-0,2500	-0,0887	0,1233
7Y	-0,2310	-1	-20	-0,1635	0,0196	0,2145
10Y	-0,0820	-1	-23	-0,0152	0,1630	0,3283
15Y	0,1490	-2	-26	0,1828	0,3094	0,4168
20Y	0,2780	-2	-26	0,2753	0,3511	0,4104
30Y	0,3060	-2	-28	0,2686	0,2988	0,3197

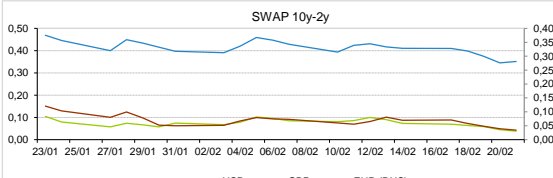
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,75
Índia	4,00



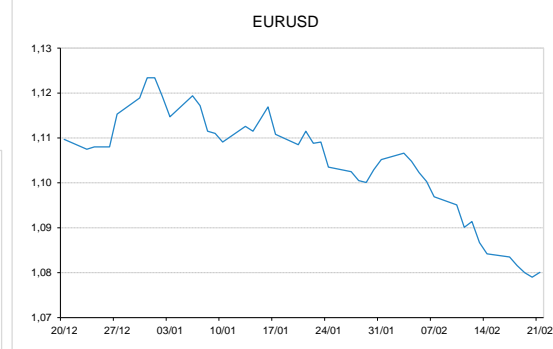
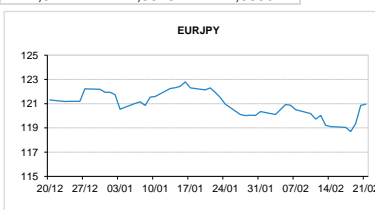
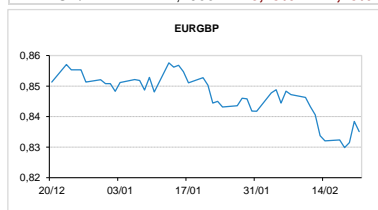
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,5730	1	-16	1,2233	1,2527	1,3695
2Y	1,4450	2	-21	1,2123	1,2740	1,3980
3Y	1,4010	2	-25	1,2255	1,3170	1,4433
4Y	1,3890	2	-25	1,2350	1,3472	1,4781
5Y	1,3950	2	-26	1,2610	1,3797	1,5072
7Y	1,4310	-7	-31	1,3299	1,4407	1,5370
10Y	1,5070	2	-33	1,4005	1,4950	1,5790
15Y	1,6050	-9	-35	1,4890	1,5570	1,6150
20Y	1,6590	-13	-35	1,5320	1,5790	1,6150
30Y	1,6780	1	-36	1,5477	1,5618	1,5713



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	58,24	-1,07	-5,59	OT 2Y	-0,452	0,00	-9,20
JETFUEL	533,64	-8,85	-81,01	OT 5Y	-0,132	0,02	-13,90
DIESEL	514,25	-7,75	-60,25	OT 10Y	0,237	0,00	-21,70
COBRE	5.737,50	-42,00	-531,00	BUND 10Y	-1,056	0,81	-17,10
ZINCO	2.104,75	-14,75	-348,50	SCHATZ 2Y	-0,011	0,23	-5,50
OURO	1.640,82	24,01	83,67	T-NOTE 10Y	2,402	-3,60	-22,00
TRIGO	558,00	-1,25	-23,00	T-NOTE 2Y	1,849	-4,18	-14,50
LICENÇA C02	25,65	0,01	0,73	GILT 10Y	0,482	-0,95	-7,00


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0801	0,10%	-2,83%	1,0861	1,0918	1,1030
EUR/GBP	0,8351	0,40%	1,82%	0,8377	0,8403	0,8456
EUR/JPY	120,96	-0,08%	1,12%	120,96	120,96	120,96
EUR/CHF	1,0620	-0,04%	1,14%	1,0611	1,0602	1,0584
EUR/BRL	4,7568	-0,39%	-1,76%	4,8005	4,8448	4,9530
EUR/PLN	4,2900	-0,19%	-1,45%	4,3117	4,3345	4,3830

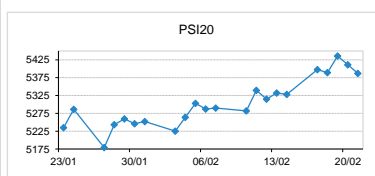

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0801	0,8351	120,96	1,0620	10,5593	7,4693	1,4345	1,63648	4,7568	10,0726
USD	0,9216	-	0,7717	111,695	0,9784	9,7276	6,8840	1,3225	1,5082	4,3808	9,2909

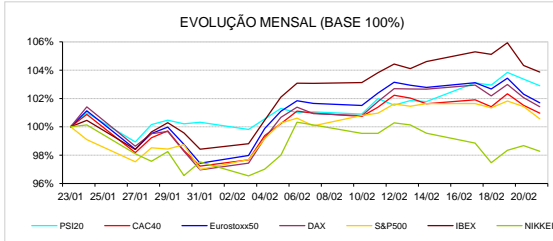
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	5,735	0,26	0,97
BCP	0,190	-0,42	-6,36
CORT. AMORIM	10,900	1,87	-3,54
CTT	2,714	-2,16	-14,92
EDP	4,878	0,08	26,24
EDP R	13,080	1,08	24,57
GALP	14,295	-1,72	-4,06
IBERSOL	8,560	-1,38	7,00
J MARTINS	17,190	1,90	17,22
MOTA ENGIL	1,609	-2,72	-13,96
NAVIGATOR	3,138	1,49	-9,00
NOS	4,138	-7,14	-13,79
PHAROL	0,099	-0,10	-0,70
RAMADA	5,800	-0,34	-0,68
REN	2,790	-0,36	2,57
SEMAPA	12,240	0,00	-10,79
SONAE CAP.	0,779	-1,27	3,45
SONAE SGPS	0,820	-0,12	-9,89

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
J MARTINS	1,90
CORT. AMORIM	1,87
NAVIGATOR	1,49
EDP R	1,08
ALTRI	0,26
IBERSOL	-1,38
GALP	-1,72
CTT	-2,16
MOTA ENGIL	-2,72
NOS	-7,14



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.387,00	-0,45%	3,32%	5.454,21	4.699,20
CAC40	6.029,72	-0,54%	0,86%	6.111,41	5.152,30
ESTX 50 PR	3.800,38	-0,59%	1,47%	3.867,28	3.239,20
XTRA DAX	13.579,33	-0,62%	2,49%	13.795,24	11.266,48
S&P 500	3.344,62	-0,85%	3,52%	3.393,52	2.722,27
IBEX 35	9.886,20	-0,45%	3,53%	10.100,20	8.409,20
NIKKEI 225	23.386,74	-0,39%	-1,14%	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.