

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

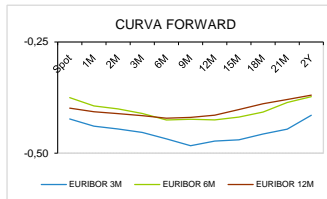
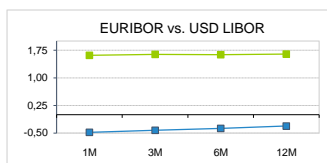
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

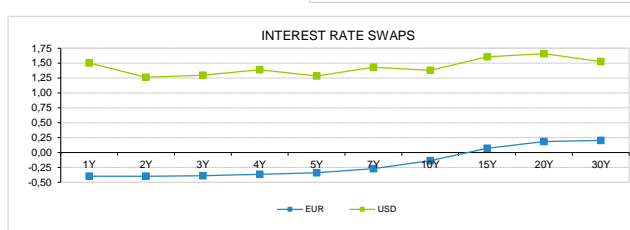
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4790	-1	-3	1M	1,6126	0	-5	0,7099	-0,7948
3M	-0,4230	-1	-4	3M	1,6376	-1	-16	0,7321	-0,7234
6M	-0,3710	-1	-5	6M	1,6286	0	-18	0,7661	-0,6914
12M	-0,3060	-1	-5	12M	1,6458	1	-23	0,8348	-0,5706

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3979	-1	-5	-0,4155	-0,2920	-0,1300
2Y	-0,3980	0	-8	-0,3907	-0,2525	-0,0806
3Y	-0,3880	-1	-10	-0,3581	-0,2114	-0,0240
4Y	-0,3660	0	-12	-0,3219	-0,1664	0,0337
5Y	-0,3390	0	-14	-0,2832	-0,1152	0,0930
7Y	-0,2710	1	-17	-0,1937	-0,0073	0,1878
10Y	-0,1370	1	-21	-0,0433	0,1369	0,3028
15Y	0,0710	2	-25	0,1552	0,2842	0,3934
20Y	0,1850	3	-27	0,2496	0,3284	0,3907
30Y	0,2040	3	-29	0,2489	0,2806	0,3018

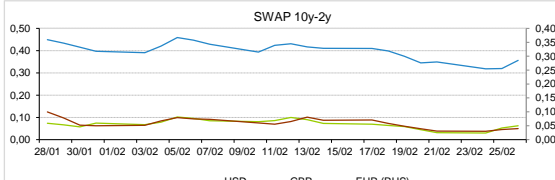
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,75
Índia	4,00



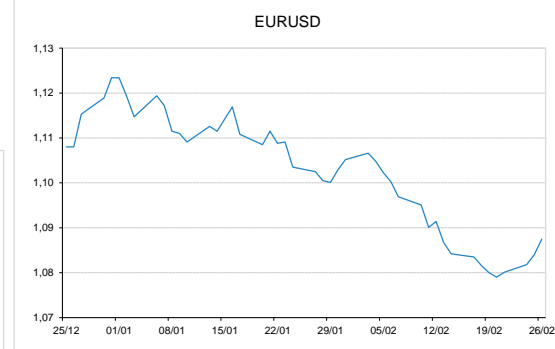
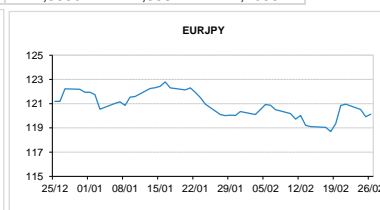
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,5030	-6	-21	1,0975	1,1110	1,2665
2Y	1,2630	-9	-29	1,0570	1,1545	1,2980
3Y	1,2970	-8	-35	1,0760	1,1920	1,3350
4Y	1,3890	2	-25	1,1085	1,2260	1,3620
5Y	1,2840	-8	-31	1,1370	1,2560	1,4112
7Y	1,4310	-7	-31	1,2000	1,3240	1,4360
10Y	1,3790	-9	-46	1,2885	1,3920	1,4790
15Y	1,6050	-9	-35	1,3845	1,4585	1,5175
20Y	1,6590	-13	-35	1,4205	1,4785	1,5165
30Y	1,5270	-10	-51	1,4310	1,4629	1,4690



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	54,71	-0,24	-5,18	OT 2Y	-0,434	0,02	0,50
JETFUEL	536,25	0,00	-45,74	OT 5Y	-0,115	0,03	-0,60
DIESEL	489,59	2,59	-49,50	OT 10Y	0,276	0,04	-3,10
COBRE	5.678,50	-4,00	-241,00	BUND 10Y	-1,119	1,67	-10,40
ZINCO	2.017,25	-15,25	-328,75	SCHATZ 2Y	-0,066	-0,46	-6,60
OURO	1.638,24	-10,58	66,71	T-NOTE 10Y	2,289	1,18	-20,20
TRIGO	537,50	0,50	-35,00	T-NOTE 2Y	1,711	0,00	-19,30
LICENÇA C02	24,44	0,26	0,06	GILT 10Y	0,460	-0,43	-1,80


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0875	0,32%	-1,36%	1,0934	1,0990	1,1093
EUR/GBP	0,8415	-0,62%	0,25%	0,8441	0,8466	0,8516
EUR/JPY	120,13	-0,17%	-0,02%	120,13	120,13	120,13
EUR/CHF	1,0629	-0,13%	0,57%	1,0620	1,0611	1,0591
EUR/BRL	4,8181	-1,16%	-3,72%	4,8575	4,9010	5,0044
EUR/PLN	4,3124	-0,22%	-0,79%	4,3350	4,3581	4,4033

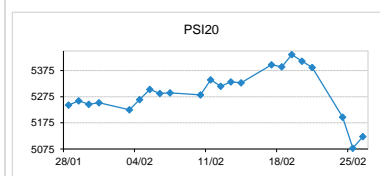

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0875	0,8415	120,13	1,0629	10,5883	7,4719	1,4494	1,66035	4,8181	10,2148
USD	0,9203	-	0,7742	110,58	0,9774	9,7441	6,8768	1,3302	1,5257	4,3988	9,3960

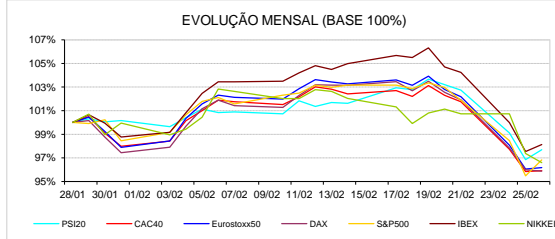
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	5,350	-0,83	-5,81
BCP	0,177	2,02	-12,82
CORT. AMORIM	10,220	-0,97	-9,56
CTT	2,542	2,01	-20,31
EDP	4,593	1,35	18,87
EDP R	12,520	0,32	19,24
GALP	13,720	0,85	-7,92
IBERSOL	8,500	-0,47	6,25
J MARTINS	16,800	1,11	14,56
MOTA ENGIL	1,438	0,07	-23,10
NAVIGATOR	2,966	-0,07	-13,99
NOS	3,922	2,46	-18,29
PHAROL	0,091	1,00	-8,73
RAMADA	5,420	-2,17	-7,19
REN	2,685	-0,19	-1,29
SEMAPA	11,660	-0,34	-15,01
SONAE CAP.	0,730	-1,48	-3,05
SONAE SGPS	0,767	0,20	-15,77

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
NOS	2,46
BCP	2,02
CTT	2,01
EDP	1,35
J MARTINS	1,11
IBERSOL	-0,47
ALTRI	-0,83
CORT. AMORIM	-0,97
SONAE CAP.	-1,48
RAMADA	-2,17



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.122,44	0,87%	-1,76%	5.454,21	4.699,20
CAC40	5.683,84	0,07%	-4,92%	6.111,41	5.152,30
ESTX 50 PR	3.576,90	0,12%	-4,49%	3.867,28	3.239,20
XTRA DAX	12.775,14	-0,12%	-3,58%	13.795,24	11.266,48
S&P 500	3.172,76	1,41%	-1,81%	3.393,52	2.722,27
IBEX 35	9.306,90	0,61%	-2,54%	10.100,20	8.409,20
NIKKEI 225	22.426,19	-0,79%	-5,20%	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.