

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

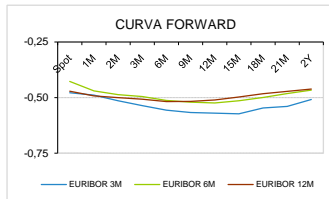
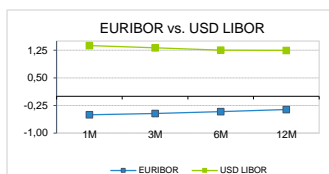
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

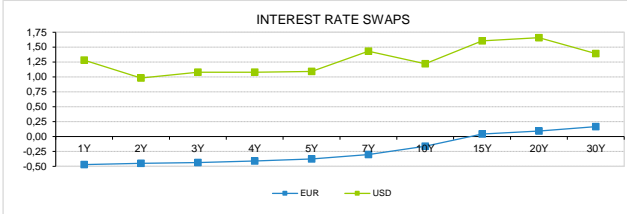
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5020	1	-4	1M	1,3768	2	-29	0,6358	-0,8380
3M	-0,4680	-1	-7	3M	1,3143	6	-43	0,6395	-0,7738
6M	-0,4180	0	-8	6M	1,2520	5	-47	0,6260	-0,7360
12M	-0,3590	0	-7	12M	1,2456	9	-52	0,7051	-0,6356

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4705	0	-11	-0,5170	-0,3970	-0,2176
2Y	-0,4500	1	-8	-0,4907	-0,3585	-0,1680
3Y	-0,4370	2	-8	-0,4581	-0,3095	-0,1145
4Y	-0,4110	3	-8	-0,4225	-0,2620	-0,0611
5Y	-0,3770	3	-8	-0,3808	-0,2110	-0,0140
7Y	-0,3010	4	-9	-0,2895	-0,1090	0,0820
10Y	-0,1620	5	-11	-0,1455	0,0285	0,1917
15Y	0,0420	6	-14	0,0467	0,1696	0,2713
20Y	0,0920	-3	-25	0,1333	0,2064	0,2626
30Y	0,1660	6	-17	0,1225	0,1511	0,1692

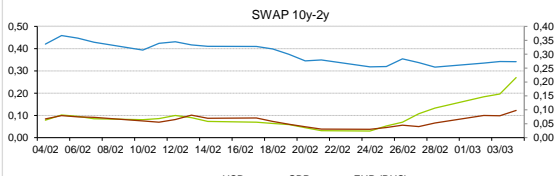
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,50
Índia	4,00



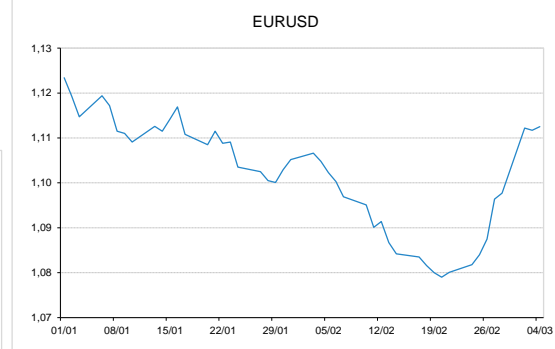
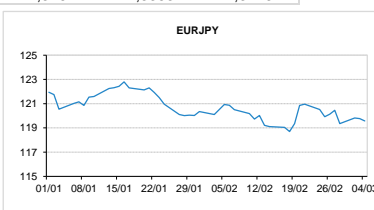
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,2810	-22	-36	0,6517	0,8150	0,9835
2Y	0,9820	-14	-54	0,6640	0,8645	1,0273
3Y	1,0790	-22	-57	0,7195	0,9066	1,0630
4Y	1,0800	-31	-35	0,7676	0,9459	1,0983
5Y	1,0930	-19	-34	0,8111	0,9830	1,1349
7Y	1,4310	-7	-31	0,8840	1,0537	1,1899
10Y	1,2200	-16	-62	0,9945	1,1290	1,2300
15Y	1,6050	-9	-35	1,1070	1,2060	1,2760
20Y	1,6590	-13	-35	1,1680	1,2427	1,2780
30Y	1,3910	-14	-65	1,1920	1,2221	1,2364



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	51,62	-0,24	-2,51	OT 2Y	-0,454	-0,03	-1,90
JETFUEL	478,42	0,07	-33,56	OT 5Y	-0,137	-0,01	-0,30
DIESEL	464,04	2,39	-26,27	OT 10Y	0,243	-0,02	-3,10
COBRE	5.660,00	-33,50	141,50	BUND 10Y	-1,257	-0,73	-19,90
ZINCO	1.958,75	-54,00	-191,25	SCHATZ 2Y	-0,190	-2,05	-15,30
OURO	1.642,94	-2,43	92,20	T-NOTE 10Y	2,007	-2,45	-43,00
TRIGO	519,25	-8,00	-35,25	T-NOTE 2Y	1,169	-6,36	-58,70
LICENÇA C02	23,77	0,41	0,41	GILT 10Y	0,328	-1,45	-17,10


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1125	0,07%	0,70%	1,1172	1,1210	1,1287
EUR/GBP	0,8685	0,18%	-2,27%	0,8709	0,8732	0,8781
EUR/JPY	119,58	0,16%	0,79%	119,58	119,58	119,58
EUR/CHF	1,0642	0,45%	0,58%	1,0632	1,0623	1,0603
EUR/BRL	5,0697	-0,60%	-7,30%	5,1153	5,1558	5,2556
EUR/PLN	4,2943	0,10%	-0,45%	4,3161	4,3353	4,3723

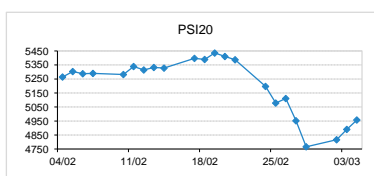

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1125	0,8685	119,58	1,0642	10,5757	7,4728	1,4946	1,68491	5,0697	10,3333
USD	0,8978	-	0,7802	107,285	0,9556	9,4885	6,7089	1,3394	1,5102	4,5423	9,2569

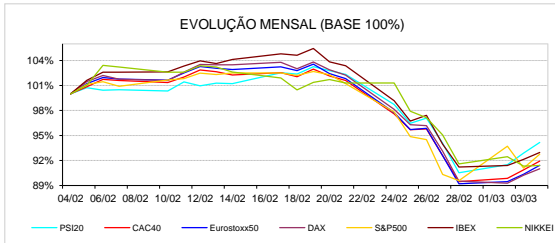
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	4,978	1,59	-12,36
BCP	0,158	-1,07	-22,29
CORT. AMORIM	10,200	1,39	-9,73
CTT	2,390	-0,83	-25,08
EDP	4,694	4,92	21,40
EDP R	13,020	2,52	24,00
GALP	12,715	-1,09	-14,66
IBERSOL	7,820	-0,26	-2,25
J MARTINS	16,440	1,95	12,10
MOTA ENGIL	1,318	-0,23	-29,52
NAVIGATOR	2,882	1,55	-16,43
NOS	3,576	0,56	-25,50
PHAROL	0,084	0,12	-15,46
RAMADA	4,750	0,64	-18,66
REN	2,655	0,19	-2,39
SEMAPA	11,520	0,88	-16,03
SONAE CAP.	0,671	-1,76	-10,89
SONAE SGPS	0,737	0,14	-19,07
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP	4,92
EDP R	2,52
J MARTINS	1,95
ALTRI	1,59
NAVIGATOR	1,55
IBERSOL	-0,26
CTT	-0,83
BCP	-1,07
GALP	-1,09
SONAE CAP.	-1,76



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.957,55	1,38%	-4,92%	5.454,21	4.699,20
CAC40	5.455,53	1,16%	-8,74%	6.111,41	5.152,30
ESTX 50 PR	3.412,55	1,20%	-8,89%	3.867,28	3.239,20
XTRA DAX	12.094,44	0,87%	-8,75%	13.795,24	11.266,48
S&P 500	3.059,77	1,85%	-5,32%	3.393,52	2.722,27
IBEX 35	8.890,80	0,90%	-6,90%	10.100,20	8.409,20
NIKKEI 225	21.100,06	0,08%	-10,81%	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.