

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

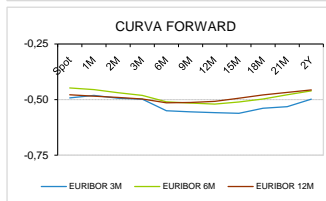
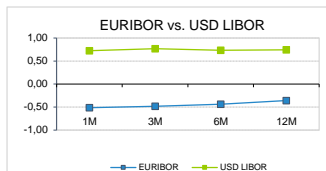
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

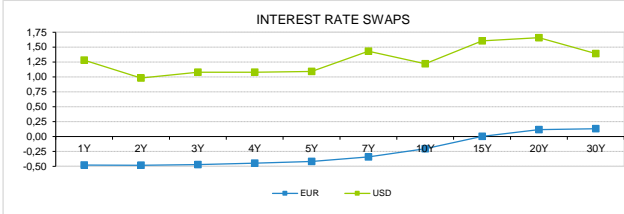
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5130	-2	-4	1M	0,7249	-14	-94	0,4964	-0,9160
3M	-0,4820	-1	-9	3M	0,7681	-13	-96	0,4719	-0,8468
6M	-0,4380	-2	-9	6M	0,7354	-14	-101	0,4853	-0,8124
12M	-0,3580	-1	-9	12M	0,7435	-10	-109	0,5709	-0,7070

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4781	-1	-11	-0,5078	-0,3784	-0,2540
2Y	-0,4820	1	-13	-0,4911	-0,3374	-0,2295
3Y	-0,4710	0	-14	-0,4538	-0,3094	-0,1940
4Y	-0,4480	0	-15	-0,4139	-0,2832	-0,1580
5Y	-0,4190	0	-16	-0,3817	-0,2501	-0,1170
7Y	-0,3430	1	-18	-0,3184	-0,1846	-0,0727
10Y	-0,2060	1	-21	-0,2230	-0,1067	-0,0164
15Y	0,0030	2	-24	-0,1183	-0,0551	-0,0176
20Y	0,1160	2	-26	-0,1042	-0,0773	-0,0706
30Y	0,1310	3	-28	-0,1946	-0,1929	-0,2014

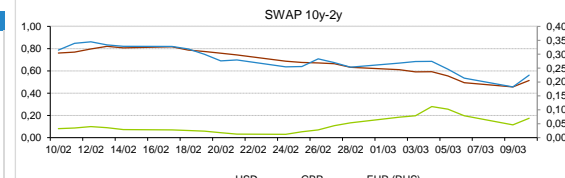
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,50
Índia	4,00



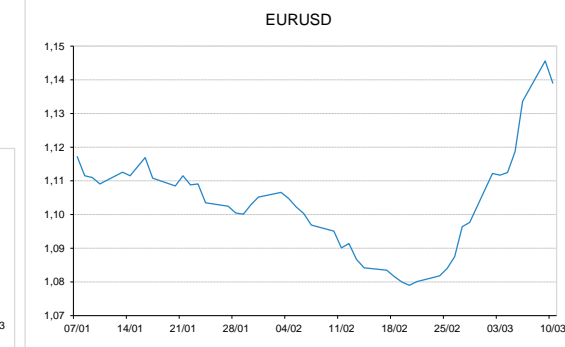
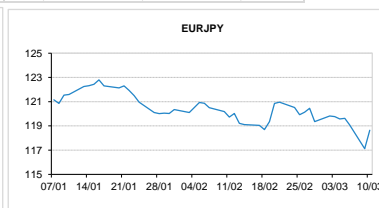
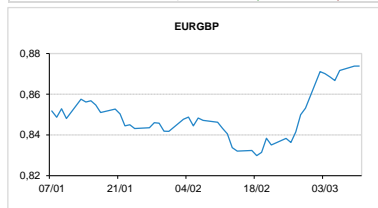
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,2810	-22	-36	0,4920	0,7100	0,7530
2Y	0,9820	-14	-54	0,5596	0,7340	0,7473
3Y	1,0790	-22	-57	0,6117	0,7440	0,7598
4Y	1,0800	-31	-35	0,6476	0,7265	0,7019
5Y	1,0930	-19	-34	0,6580	0,7440	0,7784
7Y	1,4310	-7	-31	0,6790	0,7492	0,7753
10Y	1,2200	-16	-62	0,7210	0,7620	0,7675
15Y	1,6050	-9	-35	0,7379	0,7791	0,7707
20Y	1,6590	-13	-35	0,7404	0,7572	0,7522
30Y	1,3910	-14	-65	0,7114	0,7099	0,6938



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	37,33	2,97	-16,24	OT 2Y	-0,239	0,08	14,40
JETFUEL	428,17	0,00	-90,42	OT 5Y	0,114	0,08	20,90
DIESEL	375,41	12,94	-122,46	OT 10Y	0,490	0,11	17,20
COBRE	5.524,00	-72,00	-128,00	BUND 10Y	-1,241	4,09	-41,70
ZINCO	1.962,75	-4,25	-182,25	SCHATZ 2Y	-0,333	3,86	-32,20
OURO	1.653,13	-19,66	76,64	T-NOTE 10Y	1,797	10,27	-68,80
TRIGO	518,25	-0,50	-33,25	T-NOTE 2Y	0,969	12,82	-83,50
LICENÇA C02	24,09	0,81	0,93	GILT 10Y	0,185	7,21	-36,40


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,139	-0,58%	4,01%	1,1431	1,1465	1,1534
EUR/GBP	0,87385	0,00%	-3,16%	0,8764	0,8787	0,8837
EUR/JPY	118,65	-1,29%	1,29%	118,65	118,65	118,65
EUR/CHF	1,0586	0,20%	0,75%	1,0577	1,0566	1,0547
EUR/BRL	5,2658	2,63%	-10,36%	5,3120	5,3536	5,4664
EUR/PLN	4,3168	0,25%	-1,05%	4,3384	4,3579	4,3951

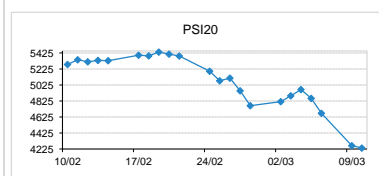

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1390	0,8739	118,65	1,0586	10,7709	7,4731	1,5575	1,74617	5,2658	10,8562
USD	0,8797	-	0,769	103,955	0,9323	9,4704	6,5740	1,3745	1,5330	4,6713	9,5625

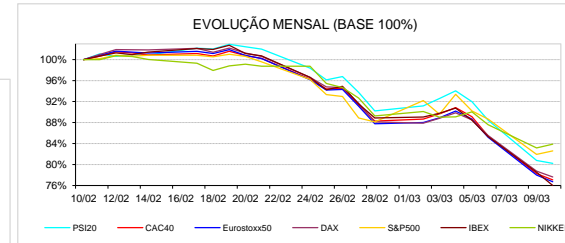
ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,150	0,88	-26,94
BCP	0,125	4,08	-38,36
CORT. AMORIM	9,200	0,99	-18,58
CTT	2,096	2,64	-34,29
EDP	3,976	-1,97	2,90
EDP R	11,480	-2,71	9,33
GALP	9,510	-0,77	-36,17
IBERSOL	6,960	-4,66	-13,00
J MARTINS	14,775	-2,54	0,75
MOTA ENGIL	1,083	6,18	-42,09
NAVIGATOR	2,420	0,41	-29,83
NOS	3,140	-0,13	-34,58
PHAROL	0,071	4,12	-28,92
RAMADA	4,460	4,69	-23,63
REN	2,430	-2,02	-10,66
SEMAPA	10,440	0,77	-23,91
SONAE CAP.	0,600	3,81	-20,32
SONAE SGPS	0,639	2,00	-29,78
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
MOTA ENGIL	6,18
RAMADA	4,69
PHAROL	4,12
BCP	4,08
SONAE CAP.	3,81
EDP	-1,97
REN	-2,02
J MARTINS	-2,54
EDP R	-2,71
IBERSOL	-4,66



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.237,23	-0,69%	-18,74%	5.454,21	4.232,89
CAC40	4.636,61	-1,51%	-22,44%	6.111,41	4.615,16
ESTX 50 PR	2.910,02	-1,66%	-22,30%	3.867,28	2.896,74
XTRA DAX	10.475,49	-1,41%	-20,93%	13.795,24	10.423,90
S&P 500	2.768,27	0,82%	-14,29%	3.393,52	2.722,27
IBEX 35	7.461,50	-3,21%	-21,86%	10.100,20	7.440,60
NIKKEI 225	19.867,12	0,85%	-16,02%	24.115,95	18.891,77



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.