

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

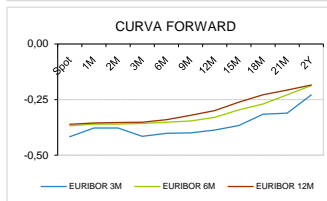
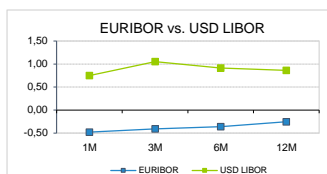
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

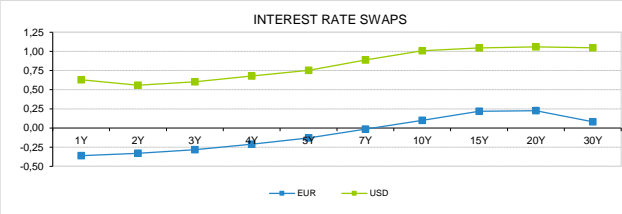
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4780	2	0	1M	0,7500	14	-90	0,2561	-0,9102
3M	-0,4080	0	-1	3M	1,0519	16	-64	0,5126	-0,8122
6M	-0,3600	1	0	6M	0,9130	7	-81	0,6066	-0,7862
12M	-0,2530	1	4	12M	0,8618	4	-93	0,7235	-0,6754

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3610	3	2	-0,3038	-0,0292	0,2238
2Y	-0,3307	5	5	-0,2449	0,0664	0,2705
3Y	-0,2820	7	9	-0,1725	0,1314	0,2870
4Y	-0,2104	9	13	-0,0883	0,1701	0,3065
5Y	-0,1302	12	17	-0,0260	0,2016	0,3162
7Y	-0,0149	14	21	0,0745	0,2551	0,3217
10Y	0,0994	15	17	0,1697	0,3212	0,3908
15Y	0,2190	17	5	0,2563	0,3249	0,3432
20Y	0,2259	18	-8	0,2362	0,2525	0,2307
30Y	0,0810	18	-25	0,0748	0,0709	0,0469

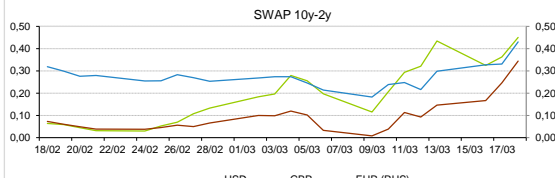
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,25
Japão	0,10
Canadá	0,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,50
Índia	4,00



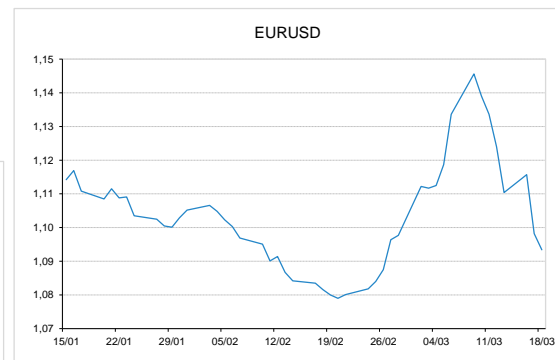
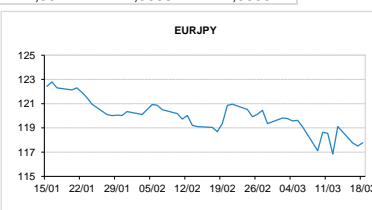
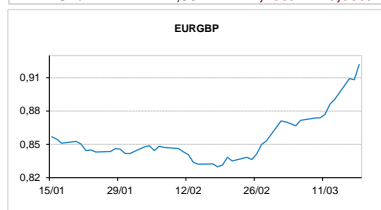
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,6308	5	-93	0,5140	0,8740	1,1705
2Y	0,5588	6	-87	0,5794	0,9605	1,2110
3Y	0,6042	7	-78	0,6782	1,0315	1,2390
4Y	0,6787	8	-69	0,7725	1,0845	1,2550
5Y	0,7521	10	-62	0,8500	1,1280	1,2748
7Y	0,8870	12	-53	0,9670	1,1730	1,2178
10Y	1,0087	15	-48	1,0470	1,1500	1,1750
15Y	1,0457	16	-55	1,0590	1,1270	1,1440
20Y	1,0590	17	-59	1,0608	1,1130	1,1205
30Y	1,0465	18	-62	1,0284	1,0568	1,0491



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	25,55	-3,18	-31,96	OT 2Y	0,267	0,13	70,00
JETFUEL	281,27	-14,00	-255,84	OT 5Y	0,916	0,15	103,60
DIESEL	306,51	-6,72	-210,74	OT 10Y	1,445	0,18	115,40
COBRE	5.145,00	-146,50	-668,00	BUND 10Y	-0,642	21,64	20,00
ZINCO	1.859,25	-74,25	-308,75	SCHATZ 2Y	-0,128	9,35	-9,80
OURO	1.486,63	-48,26	-114,96	T-NOTE 10Y	2,094	7,54	-40,00
TRIGO	509,75	10,50	-55,25	T-NOTE 2Y	0,960	-5,58	-87,20
LICENÇA C02	15,25	-3,06	-9,89	GILT 10Y	0,753	26,02	13,00


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0934	-0,44%	1,09%	1,0989	1,1018	1,1077
EUR/GBP	0,9219	-1,48%	-9,98%	0,9247	0,9270	0,9315
EUR/JPY	117,78	-0,24%	0,78%	117,78	117,78	117,78
EUR/CHF	1,0535	0,38%	0,75%	1,0525	1,0515	1,0491
EUR/BRL	5,5588	-0,90%	-15,27%	5,5983	5,6280	5,7208
EUR/PLN	4,5371	-1,48%	-5,90%	4,5577	4,5688	4,5888

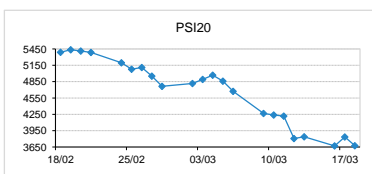

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0934	0,9219	117,78	1,0535	11,1505	7,4739	1,5754	1,8608	5,5588	12,2063
USD	0,9196	-	0,848	108,06	0,9694	10,1806	6,8725	1,4506	1,7055	5,0811	10,8588

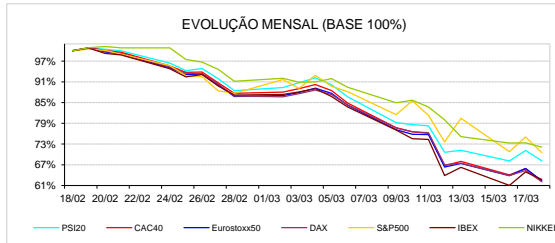
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	2,912	-9,11	-48,73
BCP	0,101	-3,81	-50,20
CORT. AMORIM	7,780	2,37	-31,15
CTT	1,998	-3,01	-37,37
EDP	3,364	-7,07	-12,94
EDP R	9,390	-7,58	-10,57
GALP	8,670	-1,79	-41,81
IBERSOL	4,240	-9,01	-47,00
J MARTINS	15,055	-2,68	2,66
MOTA ENGIL	1,142	-1,30	-38,93
NAVIGATOR	1,963	-4,62	-43,08
NOS	2,848	0,49	-40,67
PHAROL	0,065	-4,30	-35,24
RAMADA	2,980	-0,67	-48,97
REN	1,956	-3,65	-28,09
SEMAPA	7,350	-8,70	-46,43
SONAE CAP.	0,426	-5,13	-43,49
SONAE SGPS	0,513	-6,64	-43,63

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	2,37
NOS	0,49
EDP	-7,07
EDP R	-7,58
SEMAPA	-8,70
IBERSOL	-9,01
ALTRI	-9,11



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	3.673,88	-4,20%	-29,54%	5.454,21	3.547,01
CAC40	3.768,23	-5,60%	-36,97%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.394,40	-5,38%	-36,07%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	8.494,89	-4,97%	-35,88%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.376,81	-6,03%	-26,44%	3.393,52	2.367,04
IBEX 35	6.279,10	-3,38%	-34,24%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	16.726,55	-1,68%	-29,29%	24.115,95	16.378,94



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.