

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

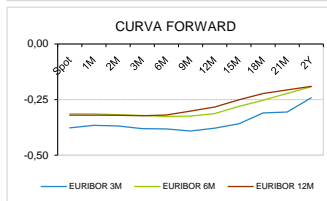
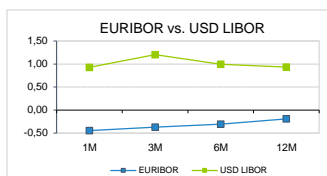
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

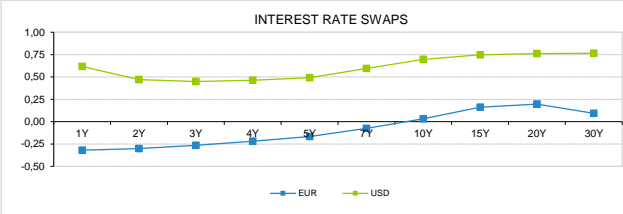
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4450	1	3	1M	0,9285	0	-70	0,2369	-0,8098
3M	-0,3690	0	5	3M	1,2041	1	-48	0,5366	-0,7008
6M	-0,3070	1	5	6M	0,9943	1	-70	0,6736	-0,6414
12M	-0,1910	-1	10	12M	0,9335	1	-83	0,7969	-0,5174

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3195	0	6	-0,2882	-0,0940	0,1164
2Y	-0,3020	-1	9	-0,2439	-0,0279	0,1517
3Y	-0,2650	-1	11	-0,1942	0,0122	0,1793
4Y	-0,2190	-1	14	-0,1358	0,0621	0,2050
5Y	-0,1673	-1	17	-0,0853	0,0968	0,2308
7Y	-0,0747	-3	19	-0,0006	0,1560	0,2667
10Y	0,0320	-3	17	0,0953	0,2280	0,3184
15Y	0,1619	-2	9	0,1981	0,2718	0,3094
20Y	0,1959	-1	1	0,2055	0,2303	0,2265
30Y	0,0930	-3	-11	0,0849	0,0819	0,0635

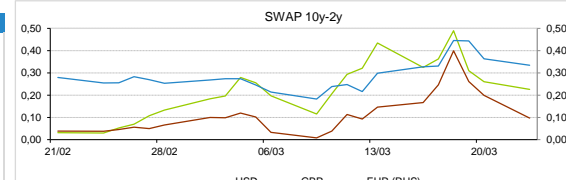
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,75
Austrália	0,25
Índia	4,00



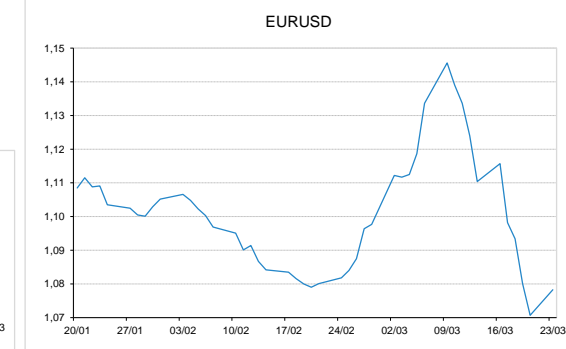
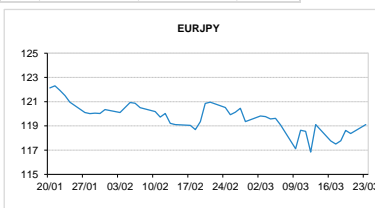
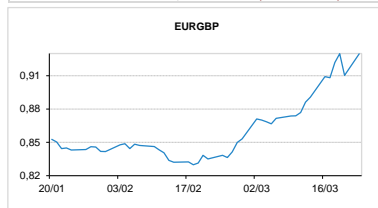
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,6174	-1	-81	0,4257	0,3600	0,7939
2Y	0,4704	-4	-78	0,3610	0,5400	0,8430
3Y	0,4489	-5	-74	0,3575	0,6246	0,8631
4Y	0,4633	-6	-71	0,4490	0,6904	0,8784
5Y	0,4911	-6	-68	0,5168	0,7343	0,8989
7Y	0,5940	-7	-61	0,6245	0,7888	0,8705
10Y	0,6960	-7	-58	0,7100	0,8008	0,8615
15Y	0,7466	-4	-62	0,7411	0,8030	0,8346
20Y	0,7617	-3	-66	0,7501	0,7911	0,8144
30Y	0,7651	-1	-67	0,7471	0,7667	0,7698



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	25,60	-1,38	-32,34	OT 2Y	-0,038	-0,02	41,20
JETFUEL	263,55	1,09	-278,94	OT 5Y	0,458	-0,01	61,40
DIESEL	309,03	1,78	-212,97	OT 10Y	0,960	0,01	72,60
COBRE	4.700,00	-15,00	-918,00	BUND 10Y	-0,799	-4,58	7,80
ZINCO	1.845,50	6,50	-263,25	SCHATZ 2Y	-0,071	-2,75	-5,00
OURO	1.551,01	52,37	-92,40	T-NOTE 10Y	1,811	-12,96	-63,80
TRIGO	558,00	18,75	6,00	T-NOTE 2Y	0,802	-7,98	-99,80
LICENÇA C02	15,22	-0,89	-10,39	GILT 10Y	0,394	-12,28	-16,40


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0783	0,71%	-0,32%	1,0830	1,0862	1,0918
EUR/GBP	0,9297	-2,09%	-9,83%	0,9321	0,9343	0,9384
EUR/JPY	119,11	-0,62%	1,18%	119,11	119,11	119,11
EUR/CHF	1,0546	0,02%	0,70%	1,0538	1,0534	1,0525
EUR/BRL	5,4918	-1,40%	-13,27%	5,5322	5,5656	5,6946
EUR/PLN	4,6110	-1,61%	-6,65%	4,6322	4,6411	4,6524

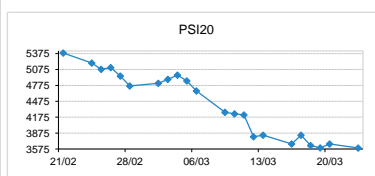

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0783	0,9297	119,11	1,0546	11,0669	7,4703	1,5581	1,85943	5,4918	12,1033
USD	0,9259	-	0,8607	110,82	0,9812	10,2534	6,9167	1,4500	1,7203	5,1143	11,4029

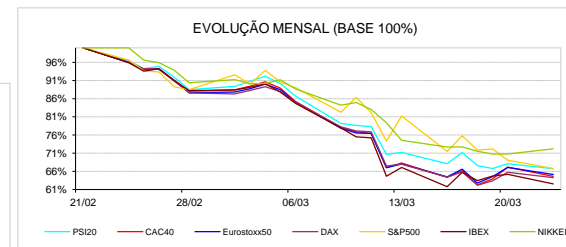
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	3,102	-1,96	-45,39
BCP	0,100	-2,52	-50,49
CORT. AMORIM	7,610	-4,88	-32,65
CTT	1,872	-0,79	-41,32
EDP	3,111	-2,32	-19,49
EDP R	8,880	-4,82	-15,43
GALP	8,266	0,27	-44,52
IBERSOL	4,600	-3,16	-42,50
J MARTINS	14,660	-1,94	-0,03
MOTA ENGIL	1,061	-0,66	-43,26
NAVIGATOR	1,923	-3,85	-44,24
NOS	2,998	-2,28	-37,54
PHAROL	0,073	-0,68	-27,21
RAMADA	2,600	0,00	-55,48
REN	1,992	-0,90	-26,76
SEMAPA	7,130	-3,91	-48,03
SONAE CAP.	0,406	-2,99	-46,15
SONAE SGPS	0,554	1,74	-39,12
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE SGPS	1,74
GALP	0,27
IBERSOL	-3,16
NAVIGATOR	-3,85
SEMAPA	-3,91
EDP R	-4,82
CORT. AMORIM	-4,88



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	3.594,46	-2,06%	-31,06%	5.454,21	3.500,02
CAC40	3.897,41	-3,74%	-34,80%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.476,14	-2,84%	-33,88%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	8.729,48	-2,23%	-34,11%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.225,56	-3,26%	-30,98%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.181,30	-4,07%	-35,27%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	16.887,78	2,02%	-28,61%	24.115,95	16.358,19



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.