

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

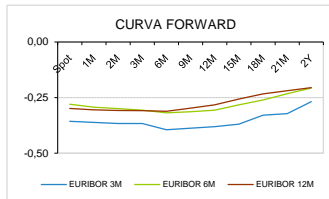
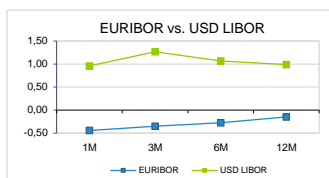
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

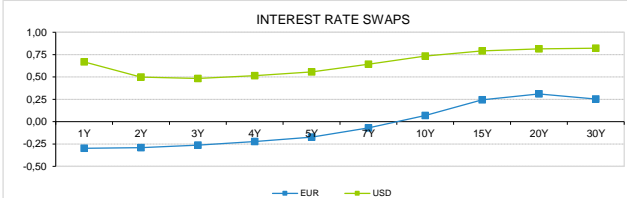
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4430	2	4	1M	0,9591	3	-65	0,2475	-0,8030
3M	-0,3490	2	7	3M	1,2670	3	-37	0,5529	-0,7046
6M	-0,2740	2	10	6M	1,0676	9	-56	0,6900	-0,6006
12M	-0,1480	3	16	12M	0,9875	3	-66	0,8101	-0,4606

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2980	0	10	-0,2908	-0,1061	0,1345
2Y	-0,2910	-2	12	-0,2509	-0,0463	0,1845
3Y	-0,2625	-4	13	-0,2027	0,0142	0,2294
4Y	-0,2222	-5	15	-0,1483	0,0689	0,2678
5Y	-0,1730	-6	17	-0,0916	0,1185	0,3090
7Y	-0,0698	-7	20	0,0133	0,2058	0,3744
10Y	0,0683	-6	19	0,1444	0,3135	0,4486
15Y	0,2443	-4	16	0,2940	0,3976	0,4678
20Y	0,3098	-3	10	0,3325	0,3811	0,4040
30Y	0,2535	0	3	0,2527	0,2664	0,2656

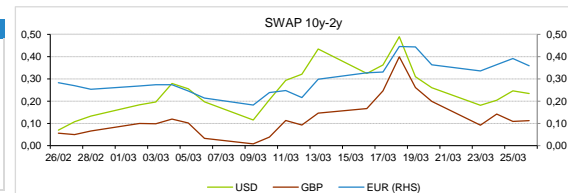
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,75
Austrália	0,25
Índia	4,00



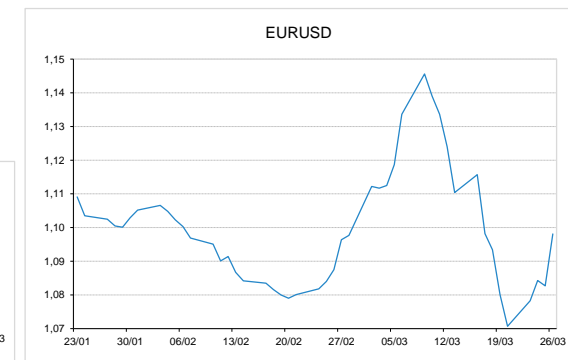
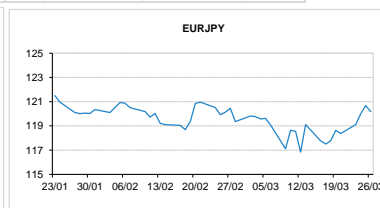
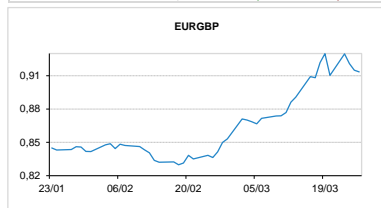
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,6690	1	-70	0,3827	0,4780	0,8202
2Y	0,4987	-2	-71	0,3899	0,6540	0,8460
3Y	0,4832	-4	-68	0,4613	0,7064	0,8650
4Y	0,5148	-4	-64	0,5055	0,7541	0,8941
5Y	0,5561	-4	-61	0,5709	0,7880	0,9133
7Y	0,6428	-4	-56	0,6655	0,8220	0,9052
10Y	0,7330	-4	-55	0,7525	0,8527	0,9003
15Y	0,7914	-3	-58	0,7928	0,8599	0,8882
20Y	0,8144	-3	-61	0,8105	0,8567	0,8755
30Y	0,8214	-2	-62	0,8121	0,8356	0,9187



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	26,83	-0,56	-25,98	OT 2Y	-0,132	-0,15	32,20
JETFUEL	254,25	0,00	-248,00	OT 5Y	0,251	-0,29	39,70
DIESEL	315,00	7,25	-174,59	OT 10Y	0,712	-0,34	47,50
COBRE	4.872,50	41,00	-830,00	BUND 10Y	-0,799	-10,16	14,90
ZINCO	1.828,50	21,75	-194,25	SCHATZ 2Y	-0,023	-5,05	4,80
OURO	1.634,06	21,40	-6,21	T-NOTE 10Y	1,862	-2,28	-42,60
TRIGO	567,00	-13,00	31,25	T-NOTE 2Y	0,872	0,56	-72,90
LICENÇA C02	17,40	-0,11	-6,86	GILT 10Y	0,341	-6,52	-12,30


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0981	1,42%	0,97%	1,1023	1,1053	1,1110
EUR/GBP	0,91348	0,17%	-7,88%	0,9156	0,9175	0,9217
EUR/JPY	120,18	0,41%	-0,04%	120,18	120,18	120,18
EUR/CHF	1,0628	0,00%	0,02%	1,0620	1,0614	1,0602
EUR/BRL	5,5448	-1,16%	-12,67%	5,5885	5,6307	5,7453
EUR/PLN	4,5485	0,42%	-5,16%	4,5660	4,5751	4,5867

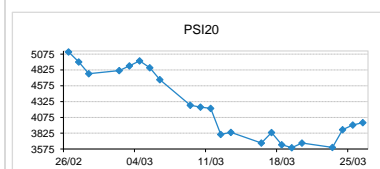

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0981	0,9135	120,18	1,0628	10,9485	7,4628	1,5487	1,81909	5,5448	11,5016
USD	0,9106	-	0,8304	109,85	0,9682	9,9854	6,7979	1,4069	1,6588	5,0060	10,5067

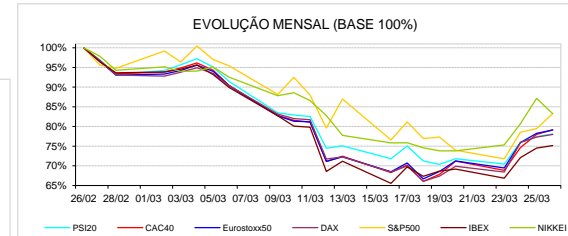
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	3,620	-1,15	-36,27
BCP	0,110	0,83	-45,81
CORT. AMORIM	8,030	2,16	-28,94
CTT	2,028	2,48	-36,43
EDP	3,553	-1,58	-8,05
EDP R	10,140	4,00	-3,43
GALP	9,720	1,02	-34,77
IBERSOL	5,100	3,03	-36,25
J MARTINS	15,760	0,67	7,47
MOTA ENGIL	1,135	0,44	-39,30
NAVIGATOR	2,168	-0,09	-37,13
NOS	3,100	-2,15	-35,42
PHAROL	0,072	-2,85	-28,21
RAMADA	2,870	6,30	-50,86
REN	2,315	5,71	-14,89
SEMAPA	7,970	0,89	-41,91
SONAE CAP.	0,420	-1,18	-44,22
SONAE SGPS	0,586	-0,85	-35,66

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
RAMADA	6,30
REN	5,71
EDP R	4,00
IBERSOL	3,03
CTT	2,48
ALTRI	-1,15
SONAE CAP.	-1,18
EDP	-1,58
NOS	-2,15
PHAROL	-2,85



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	3.991,12	0,90%	-23,46%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.499,82	1,52%	-24,73%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.830,02	1,07%	-24,44%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	9.963,23	0,90%	-24,80%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.595,83	4,82%	-19,68%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.002,70	0,87%	-26,67%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	18.664,60	-4,51%	-21,10%	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.