

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

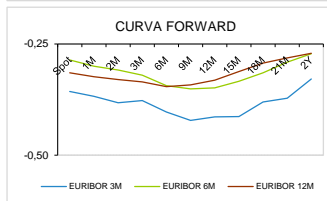
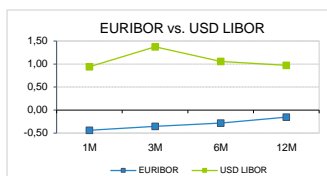
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

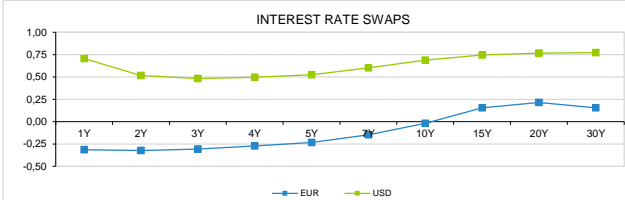
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4380	1	5	1M	0,9409	-2	-66	0,2484	-0,7960
3M	-0,3530	0	7	3M	1,3746	11	-24	0,5528	-0,6742
6M	-0,2810	-1	9	6M	1,0576	-1	-53	0,6875	-0,5770
12M	-0,1530	-1	15	12M	0,9728	-1	-64	0,8350	-0,4576

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3145	-1	9	-0,3315	-0,1823	0,0060
2Y	-0,3230	-3	9	-0,3012	-0,1349	0,0583
3Y	-0,3062	-4	9	-0,2711	-0,0876	0,1032
4Y	-0,2725	-5	10	-0,2258	-0,0381	0,1459
5Y	-0,2334	-5	12	-0,1794	0,0114	0,1960
7Y	-0,1470	-7	13	-0,0809	0,0966	0,2635
10Y	-0,0191	-8	12	0,0501	0,2108	0,3401
15Y	0,1539	-8	9	0,1965	0,2932	0,3578
20Y	0,2144	-9	3	0,2314	0,2764	0,2981
30Y	0,1543	-8	-5	0,1523	0,1652	0,1660

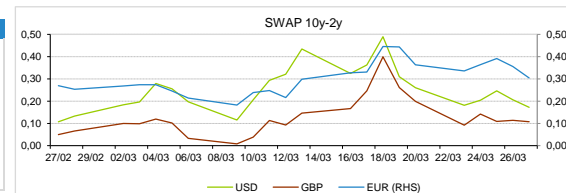
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,75
Austrália	0,25
Índia	4,00



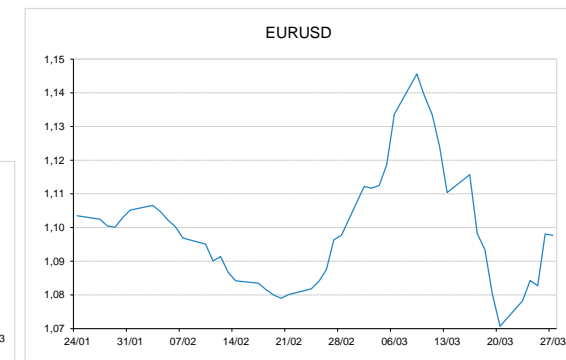
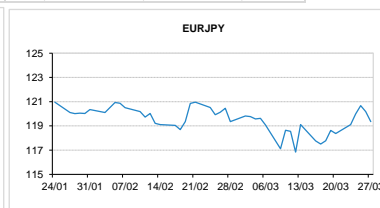
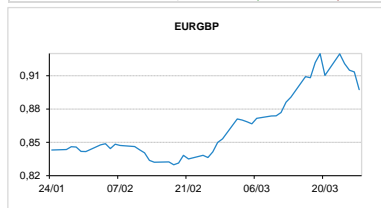
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,7060	3	-60	0,3483	0,4015	0,7629
2Y	0,5158	1	-64	0,3690	0,5740	0,7815
3Y	0,4821	0	-64	0,3940	0,6330	0,8060
4Y	0,4963	-1	-63	0,4710	0,6730	0,8280
5Y	0,5250	-1	-62	0,5305	0,7010	0,8605
7Y	0,6022	-2	-58	0,6005	0,7640	0,8528
10Y	0,6881	-2	-58	0,6995	0,7922	0,8448
15Y	0,7449	-2	-62	0,7394	0,8030	0,8393
20Y	0,7663	-1	-65	0,7574	0,8004	0,8209
30Y	0,7715	-1	-67	0,7564	0,7768	0,7780



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	24,58	-1,76	-27,15	OT 2Y	-0,162	-0,04	26,70
JETFUEL	254,25	0,00	-222,41	OT 5Y	0,203	-0,06	31,60
DIESEL	306,25	-8,75	-160,70	OT 10Y	0,666	-0,05	39,00
COBRE	4.814,00	-51,00	-866,00	BUND 10Y	-0,915	-11,63	2,10
ZINCO	1.853,75	25,25	-185,75	SCHATZ 2Y	-0,092	-7,56	-1,60
OURO	1.627,00	-11,03	-13,82	T-NOTE 10Y	1,803	-4,68	-46,50
TRIGO	572,75	3,75	45,25	T-NOTE 2Y	0,869	2,04	-69,60
LICENÇA C02	16,43	-0,92	-7,17	GILT 10Y	0,322	-2,05	-13,80


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0977	-0,04%	0,12%	1,1021	1,1053	1,1113
EUR/GBP	0,89743	1,79%	-5,29%	0,8995	0,9016	0,9059
EUR/JPY	119,36	0,69%	0,92%	119,36	119,36	119,36
EUR/CHF	1,0600	0,19%	0,63%	1,0591	1,0585	1,0574
EUR/BRL	5,6562	-2,01%	-12,73%	5,6979	5,7421	5,8678
EUR/PLN	4,5275	0,10%	-4,73%	4,5455	4,5565	4,5728

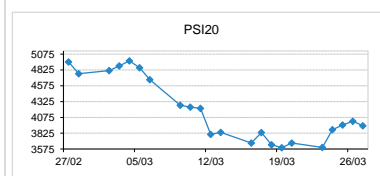

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0977	0,8974	119,36	1,0600	11,0247	7,4626	1,5567	1,80291	5,6562	11,5737
USD	0,9087	-	0,8137	108,115	0,9609	9,9927	6,7807	1,4099	1,6483	5,1091	10,6039

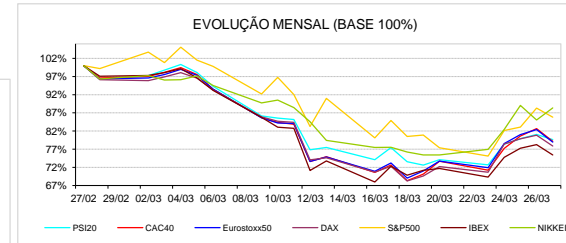
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	3,488	-3,91	-38,59
BCP	0,106	-4,00	-47,98
CORT. AMORIM	8,100	0,00	-28,32
CTT	2,052	1,79	-35,67
EDP	3,518	-1,76	-8,95
EDP R	10,080	-1,18	-4,00
GALP	9,744	-0,57	-34,60
IBERSOL	5,160	0,39	-35,50
J MARTINS	16,085	1,04	9,68
MOTA ENGIL	1,087	-4,57	-41,87
NAVIGATOR	2,074	-4,78	-39,86
NOS	3,052	-1,68	-36,42
PHAROL	0,069	-3,90	-30,72
RAMADA	2,900	1,05	-50,34
REN	2,260	-3,21	-16,91
SEMAPA	7,630	-4,39	-44,39
SONAE CAP.	0,400	-5,21	-46,88
SONAE SGPS	0,577	-2,04	-36,59

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
CTT	1,79
RAMADA	1,05
J MARTINS	1,04
IBERSOL	0,39
BCP	-4,00
SEMAPA	-4,39
MOTA ENGIL	-4,57
NAVIGATOR	-4,78
SONAE CAP.	-5,21



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	3.942,86	-1,76%	-24,38%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.351,49	-4,23%	-27,21%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.728,65	-4,18%	-27,14%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	9.632,52	-3,68%	-27,30%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.555,42	-2,82%	-20,89%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.777,90	-3,63%	-29,02%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	19.389,43	3,88%	-18,04%	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.