

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

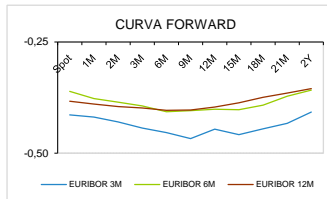
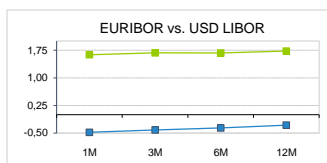
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

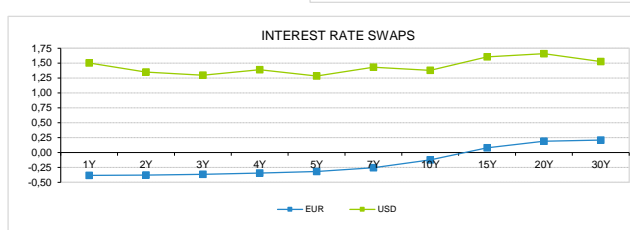
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4770	0	-3	1M	1,6268	0	-3	0,7104	-0,7890
3M	-0,4140	0	-3	3M	1,6793	0	-13	0,7478	-0,7170
6M	-0,3570	0	-3	6M	1,6748	-2	-16	0,8011	-0,6802
12M	-0,2840	0	-3	12M	1,7286	-3	-19	0,8868	-0,5512

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3833	-1	-5	-0,3974	-0,2950	-0,1490
2Y	-0,3790	0	-8	-0,3767	-0,2641	-0,0948
3Y	-0,3650	0	-10	-0,3495	-0,2270	-0,0401
4Y	-0,3440	0	-13	-0,3204	-0,1802	0,0165
5Y	-0,3190	-1	-16	-0,2868	-0,1300	0,0703
7Y	-0,2550	-2	-20	-0,2001	-0,0245	0,1675
10Y	-0,1230	-4	-25	-0,0550	0,1170	0,2786
15Y	0,0800	-7	-30	0,1371	0,2605	0,3663
20Y	0,1910	-9	-33	0,2286	0,3019	0,3611
30Y	0,2090	-10	-35	0,2225	0,2510	0,2708

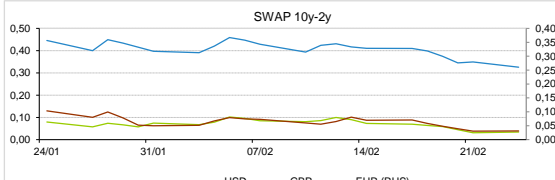
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,75
Índia	4,00



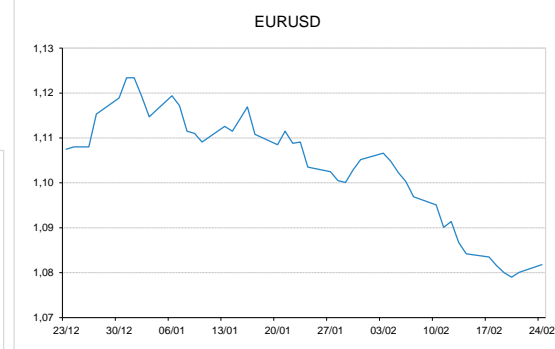
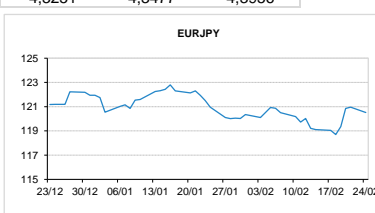
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,5030	-6	-21	1,2097	1,1248	1,2570
2Y	1,3510	-7	-26	1,2602	1,1460	1,3004
3Y	1,2970	-8	-35	1,0915	1,3784	1,3345
4Y	1,3890	2	-25	1,1169	1,2286	1,3696
5Y	1,2840	-8	-31	1,1465	1,2629	1,3999
7Y	1,4310	-7	-31	1,2080	1,3276	1,5333
10Y	1,3790	-9	-46	1,2820	1,3965	1,4841
15Y	1,6050	-9	-35	1,3855	1,4576	1,5194
20Y	1,6590	-13	-35	1,4295	1,4500	1,5185
30Y	1,5270	-10	-51	1,4329	1,4460	1,4618



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	55,35	-3,15	-4,54	OT 2Y	-0,456	0,00	-7,10
JETFUEL	533,64	-8,85	-81,01	OT 5Y	-0,146	-0,01	-10,90
DIESEL	514,25	-7,75	-60,25	OT 10Y	0,225	-0,01	-17,90
COBRE	5.765,00	37,00	-395,00	BUND 10Y	-1,100	-3,77	-16,70
ZINCO	2.101,50	-3,25	-363,75	SCHATZ 2Y	-0,046	-3,21	-7,40
OURO	1.674,03	30,61	102,50	T-NOTE 10Y	2,311	-8,65	-28,80
TRIGO	533,25	-18,75	-39,25	T-NOTE 2Y	1,758	-9,12	-22,60
LICENÇA C02	24,52	-1,09	0,14	GILT 10Y	0,425	-4,15	-7,70


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0818	0,16%	-1,97%	1,0877	1,0932	1,1039
EUR/GBP	0,83833	-0,39%	0,57%	0,8409	0,8435	0,8486
EUR/JPY	120,52	0,37%	0,37%	120,52	120,52	120,52
EUR/CHF	1,0620	-0,04%	0,84%	1,0612	1,0602	1,0582
EUR/BRL	4,7619	-0,51%	-1,88%	4,8033	4,8464	4,9529
EUR/PLN	4,3033	-0,36%	-1,09%	4,3251	4,3477	4,3956


FIXINGS CONTRA USD e EUR

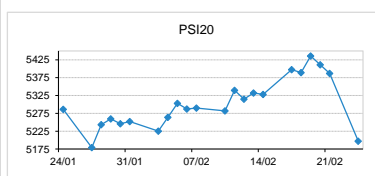
	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0818	0,8383	120,52	1,0620	10,5727	7,4715	1,4426	1,64223	4,7619	10,1361
USD	0,9212	-	0,7738	110,645	0,9779	9,7323	6,8823	1,3268	1,5111	4,3888	9,3338

ACCIONISTA

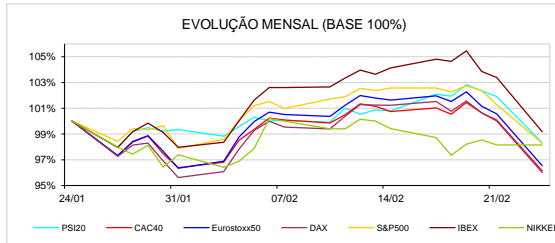
TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	5,570	-2,88	-1,94
BCP	0,180	-5,16	-11,19
CORT. AMORIM	10,560	-3,12	-6,55
CTT	2,578	-5,01	-19,18
EDP	4,705	-3,55	21,77
EDP R	12,800	-2,14	21,90
GALP	13,740	-3,88	-7,79
IBERSOL	8,540	-0,23	6,75
J MARTINS	16,715	-2,76	13,98
MOTA ENGIL	1,515	-5,84	-18,98
NAVIGATOR	3,074	-2,04	-10,86
NOS	3,898	-5,80	-18,79
PHAROL	0,095	-3,84	-4,52
RAMADA	5,560	-4,14	-4,79
REN	2,730	-2,15	0,37
SEMAPA	11,900	-2,78	-13,27
SONAE CAP.	0,762	-2,18	1,20
SONAE SGPS	0,783	-4,57	-14,01

MAIORES GANHOS/PERDAS

Título	Variação %
SONAE SGPS	-4,57
CTT	-5,01
BCP	-5,16
NOS	-5,80
MOTA ENGIL	-5,84



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.197,09	-3,53%	-0,33%	5.454,21	4.699,20
CAC40	5.791,87	-3,94%	-3,11%	6.111,41	5.152,30
ESTX 50 PR	3.647,98	-4,01%	-2,59%	3.867,28	3.239,20
XTRA DAX	13.035,24	-4,01%	-1,61%	13.795,24	11.266,48
S&P 500	3.239,43	-2,96%	0,26%	3.393,52	2.722,27
IBEX 35	9.483,50	-4,07%	-0,69%	10.100,20	8.409,20
NIKKEI 225	23.386,74	-0,39%	-1,14%	24.115,95	20.110,76



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.