

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

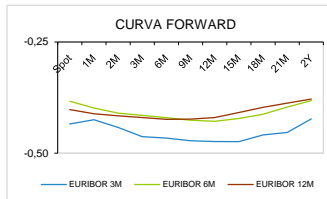
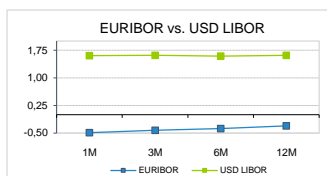
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

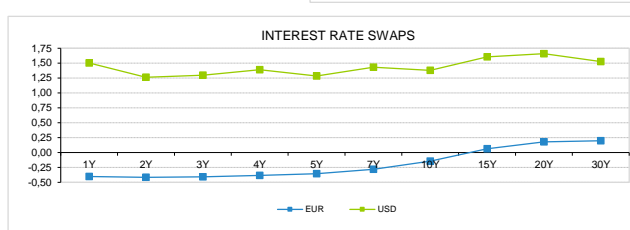
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4880	-1	-4	1M	1,6034	-1	-6	0,7128	-0,8014
3M	-0,4250	0	-3	3M	1,6133	-2	-18	0,7268	-0,7312
6M	-0,3750	0	-4	6M	1,5903	-4	-22	0,7479	-0,7002
12M	-0,3030	0	-4	12M	1,6101	-4	-27	0,8073	-0,5862

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4018	-1	-6	-0,4210	-0,3195	-0,1645
2Y	-0,4160	-2	-10	-0,4015	-0,2795	-0,1175
3Y	-0,4080	-2	-12	-0,3727	-0,2404	-0,0635
4Y	-0,3830	-2	-14	-0,3398	-0,1975	-0,0055
5Y	-0,3540	-2	-15	-0,3045	-0,1490	0,0530
7Y	-0,2820	-1	-18	-0,2200	-0,0420	0,1460
10Y	-0,1440	-1	-21	-0,0745	0,0970	0,2597
15Y	0,0640	-1	-25	0,1182	0,2420	0,3470
20Y	0,1780	-1	-27	0,2100	0,2849	0,3438
30Y	0,1980	-1	-30	0,2071	0,2359	0,2559

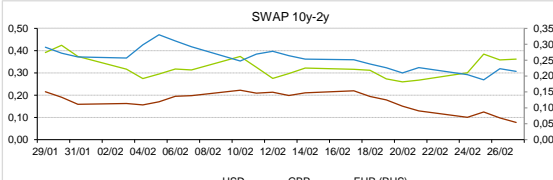
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,75
Índia	4,00



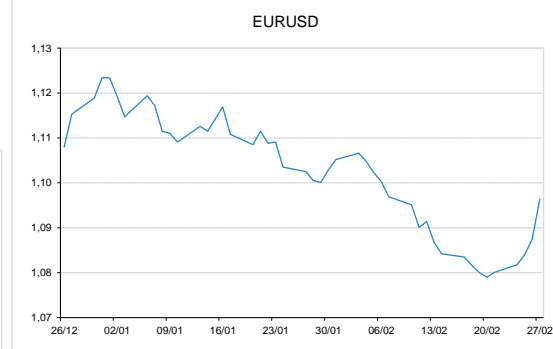
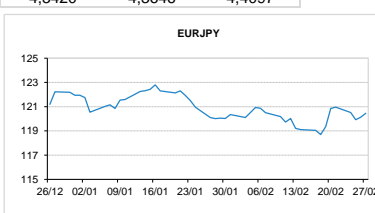
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,5030	-6	-21	1,0150	1,0595	1,2370
2Y	1,2630	-9	-29	1,0030	1,1290	1,2650
3Y	1,2970	-8	-35	1,0363	1,1640	1,2960
4Y	1,3890	2	-25	1,0350	1,1980	1,3280
5Y	1,2840	-8	-31	1,0930	1,1805	1,3803
7Y	1,4310	-7	-31	1,1585	1,2930	1,3815
10Y	1,3790	-9	-46	1,2535	1,3625	1,4679
15Y	1,6050	-9	-35	1,3460	1,4260	1,5040
20Y	1,6590	-13	-35	1,4073	1,4490	1,4840
30Y	1,5270	-10	-51	1,4131	1,4321	1,4400



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	51,68	-1,75	-6,90	OT 2Y	-0,360	0,07	5,70
JETFUEL	466,84	-69,41	-83,38	OT 5Y	-0,022	0,09	-1,70
DIESEL	449,75	-17,20	-60,75	OT 10Y	0,375	0,10	3,60
COBRE	5.660,50	-15,00	-256,00	BUND 10Y	-1,174	-5,14	-19,60
ZINCO	2.034,50	17,25	-311,50	SCHATZ 2Y	-0,105	-3,89	-10,70
OURO	1.647,52	7,25	67,30	T-NOTE 10Y	2,239	-1,92	-27,90
TRIGO	527,75	-8,00	-43,50	T-NOTE 2Y	1,618	-5,30	-16,00
LICENÇA C02	23,60	-0,66	-0,99	GILT 10Y	0,412	-4,75	-11,00


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0964	0,82%	-0,55%	1,1023	1,1075	1,1175
EUR/GBP	0,84995	-0,99%	-0,75%	0,8526	0,8551	0,8601
EUR/JPY	120,46	-0,27%	-0,29%	120,46	120,46	120,46
EUR/CHF	1,0666	-0,33%	0,21%	1,0658	1,0648	1,0628
EUR/BRL	4,8937	-1,03%	-5,20%	4,9368	4,9771	5,0788
EUR/PLN	4,3191	-0,12%	-0,95%	4,3420	4,3646	4,4097


FIXINGS CONTRA USD e EUR

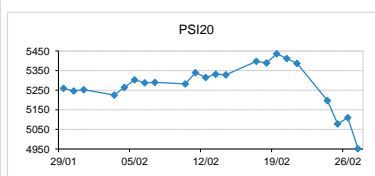
	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0964	0,8500	120,46	1,0666	10,6021	7,4726	1,4658	1,66755	4,8937	10,3116
USD	0,9100	-	0,7768	109,955	0,9697	9,6481	6,8005	1,3353	1,5201	4,4762	9,3971

ACCIONISTA

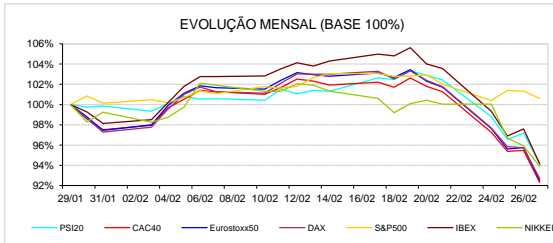
TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	5,110	-4,13	-10,04
BCP	0,172	-2,27	-15,04
CORT. AMORIM	10,140	-0,78	-10,27
CTT	2,424	-4,34	-24,01
EDP	4,402	-3,59	13,92
EDP R	12,460	-1,11	18,67
GALP	13,025	-5,00	-12,58
IBERSOL	8,240	0,00	3,00
J MARTINS	16,380	-2,50	11,69
MOTA ENGIL	1,397	-2,78	-25,29
NAVIGATOR	2,884	-2,37	-16,37
NOS	3,724	-4,46	-22,42
PHAROL	0,087	-2,36	-12,65
RAMADA	5,380	-0,37	-7,88
REN	2,605	-2,80	-4,23
SEMAPA	11,420	-1,89	-16,76
SONAE CAP.	0,715	-1,79	-5,05
SONAE SGPS	0,730	-4,45	-19,78

MAIORES GANHOS/PERDAS

Título	Variação %
ALTRI	-4,13
CTT	-4,34
SONAE SGPS	-4,45
NOS	-4,46
GALP	-5,00



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.952,15	-3,10%	-5,02%	5.454,21	4.699,20
CAC40	5.495,60	-3,32%	-8,07%	6.111,41	5.152,30
ESTX 50 PR	3.455,92	-3,40%	-7,72%	3.867,28	3.239,20
XTRA DAX	12.367,46	-3,19%	-6,65%	13.795,24	11.266,48
S&P 500	3.044,14	-2,35%	-5,81%	3.393,52	2.722,27
IBEX 35	8.985,90	-3,55%	-5,90%	10.100,20	8.409,20
NIKKEI 225	21.948,23	-2,13%	-7,22%	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.