

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

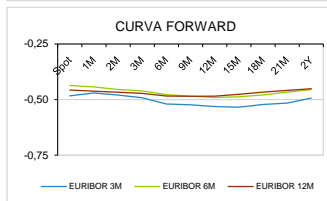
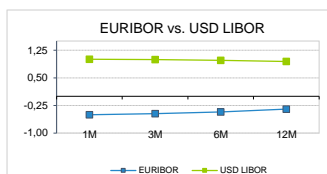
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

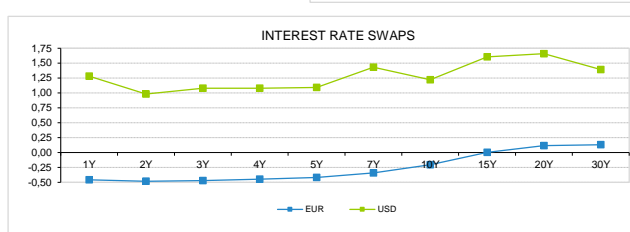
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5010	1	-4	1M	1,0051	-1	-66	0,5724	-0,8582
3M	-0,4730	0	-7	3M	0,9989	0	-74	0,5506	-0,7948
6M	-0,4270	1	-8	6M	0,9746	-1	-78	0,5483	-0,7678
12M	-0,3480	1	-8	12M	0,9443	-2	-89	0,6135	-0,6696

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4570	0	-10	-0,4840	-0,3998	-0,2726
2Y	-0,4820	1	-13	-0,4743	-0,3616	-0,2290
3Y	-0,4710	0	-14	-0,4489	-0,3439	-0,1836
4Y	-0,4480	0	-15	-0,4173	-0,2950	-0,1356
5Y	-0,4190	0	-16	-0,3883	-0,2542	-0,0838
7Y	-0,3430	1	-18	-0,3163	-0,1671	-0,0122
10Y	-0,2060	1	-21	-0,1940	-0,0464	0,0901
15Y	0,0030	2	-24	-0,0291	0,0742	0,1590
20Y	0,1160	2	-26	0,0448	0,1041	0,1479
30Y	0,1310	3	-28	0,0211	0,0408	0,0527

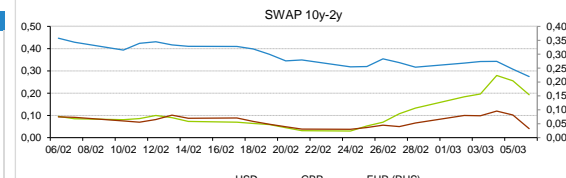
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,50
Índia	4,00



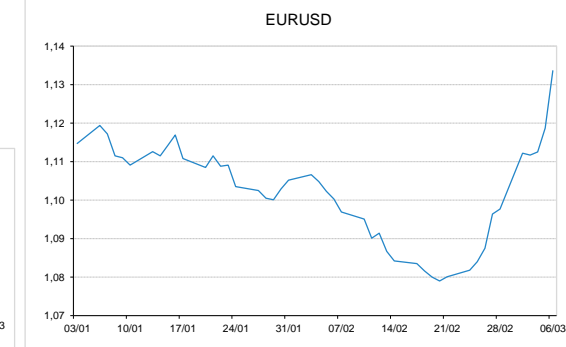
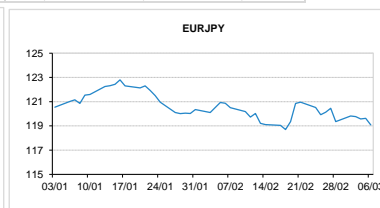
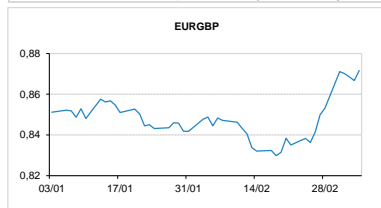
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,2810	-22	-36	0,5206	0,6890	0,8045
2Y	0,9820	-14	-54	0,5655	0,7225	0,8291
3Y	1,0790	-22	-57	0,6068	0,7485	0,8560
4Y	1,0800	-31	-35	0,6430	0,7749	0,8740
5Y	1,0930	-19	-34	0,6750	0,7980	0,9114
7Y	1,4310	-7	-31	0,7330	0,8450	0,9245
10Y	1,2200	-16	-62	0,8050	0,8915	0,9530
15Y	1,6050	-9	-35	0,8730	0,9340	0,9730
20Y	1,6590	-13	-35	0,9030	0,9435	0,9670
30Y	1,3910	-14	-65	0,9002	0,9159	0,9150



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	46,20	-3,79	-9,06	OT 2Y	-0,390	0,02	0,20
JETFUEL	466,95	-8,85	-71,34	OT 5Y	-0,065	0,03	2,50
DIESEL	457,21	-8,04	-55,92	OT 10Y	0,297	0,00	-4,30
COBRE	5.671,00	-10,00	-48,00	BUND 10Y	-1,151	-3,41	-34,50
ZINCO	1.993,50	29,25	-224,25	SCHATZ 2Y	-0,233	-0,23	-22,40
OURO	1.664,25	-2,87	98,89	T-NOTE 10Y	1,848	-11,14	-69,20
TRIGO	514,25	-4,50	-39,25	T-NOTE 2Y	1,017	-9,51	-83,00
LICENÇA C02	23,46	-0,35	-0,10	GILT 10Y	0,184	-9,73	-39,20


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1336	1,33%	3,03%	1,1379	1,1415	1,1487
EUR/GBP	0,87165	-0,57%	-2,67%	0,8741	0,8763	0,8811
EUR/JPY	119,08	0,46%	1,50%	119,08	119,08	119,08
EUR/CHF	1,0599	0,26%	0,99%	1,0588	1,0576	1,0554
EUR/BRL	5,2566	-1,40%	-10,55%	5,3023	5,3434	5,4471
EUR/PLN	4,3014	0,13%	-1,00%	4,3234	4,3445	4,3824


FIXINGS CONTRA USD e EUR

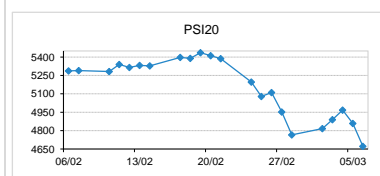
	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1336	0,8717	119,08	1,0599	10,6009	7,4698	1,5193	1,70588	5,2566	10,4677
USD	0,8841	-	0,7672	105,345	0,9377	9,3618	6,6038	1,3428	1,5084	4,6174	9,2625

ACCIONISTA

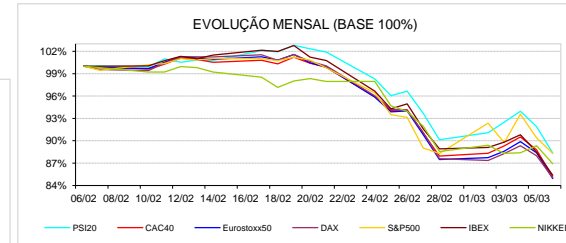
TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,574	-5,96	-19,47
BCP	0,142	-5,09	-30,18
CORT. AMORIM	9,940	-0,80	-12,04
CTT	2,228	-3,38	-30,16
EDP	4,372	-4,60	13,15
EDP R	12,720	-3,34	21,14
GALP	11,480	-7,27	-22,95
IBERSOL	7,740	-1,78	-3,25
J MARTINS	16,035	-1,78	9,34
MOTA ENGIL	1,189	-3,33	-36,42
NAVIGATOR	2,664	-3,55	-22,75
NOS	3,366	-3,05	-29,88
PHAROL	0,078	-4,88	-21,69
RAMADA	4,540	-1,30	-22,26
REN	2,595	-2,08	-4,60
SEMAPA	10,980	-3,68	-19,97
SONAE CAP.	0,634	-3,21	-15,80
SONAE SGPS	0,688	-4,91	-24,45

MAIORES GANHOS/PERDAS

Título	Variação %
PHAROL	-4,88
SONAE SGPS	-4,91
BCP	-5,09
ALTRI	-5,96
GALP	-7,27



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.671,50	-3,85%	-10,41%	5.454,21	4.649,58
CAC40	5.139,11	-4,14%	-14,03%	6.111,41	5.117,57
ESTX 50 PR	3.232,07	-3,91%	-13,70%	3.867,28	3.216,44
XTRA DAX	11.541,87	-3,37%	-12,89%	13.795,24	11.266,48
S&P 500	2.954,28	-2,30%	-8,56%	3.393,52	2.722,27
IBEX 35	8.375,60	-3,54%	-12,29%	10.100,20	8.310,40
NIKKEI 225	20.749,75	-2,72%	-12,29%	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.