

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

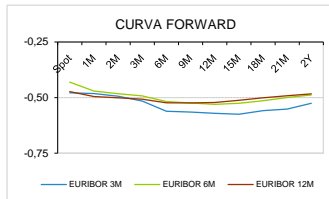
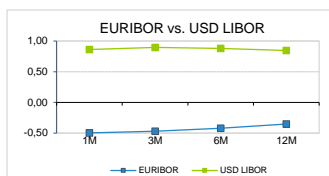
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

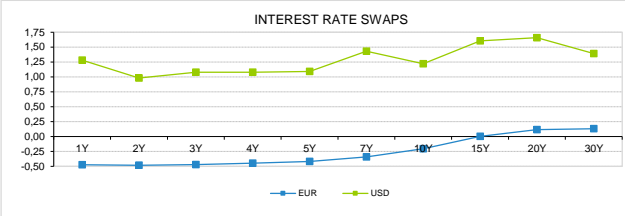
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4960	1	-4	1M	0,8626	-14	-81	0,5590	-0,8798
3M	-0,4680	1	-7	3M	0,8960	-10	-84	0,5179	-0,8134
6M	-0,4210	1	-8	6M	0,8799	-9	-87	0,5251	-0,7778
12M	-0,3520	0	-8	12M	0,8456	-10	-100	0,6021	-0,6806

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4731	-2	-11	-0,5230	-0,4403	-0,3298
2Y	-0,4820	1	-13	-0,5072	-0,4100	-0,2956
3Y	-0,4710	0	-14	-0,4850	-0,3823	-0,2606
4Y	-0,4480	0	-15	-0,4581	-0,3520	-0,2289
5Y	-0,4190	0	-16	-0,4321	-0,3192	-0,1905
7Y	-0,3430	1	-18	-0,3728	-0,2473	-0,1685
10Y	-0,2060	1	-21	-0,2705	-0,1518	-0,0453
15Y	0,0030	2	-24	-0,1439	-0,0650	-0,0034
20Y	0,1160	2	-26	-0,0954	-0,0553	-0,0301
30Y	0,1310	3	-28	-0,1460	-0,1381	-0,1370

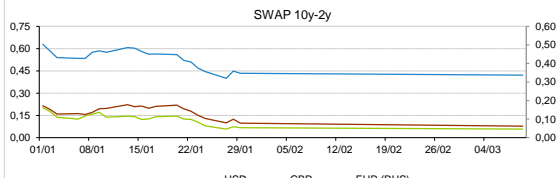
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,50
Índia	4,00



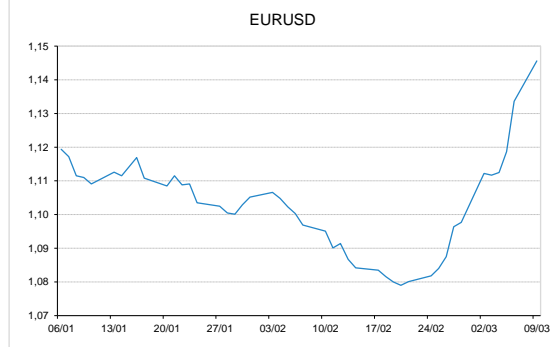
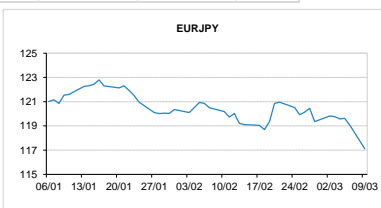
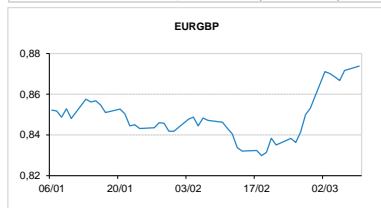
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,2810	-22	-36	0,6954	0,8105	0,6435
2Y	0,9820	-14	-54	0,7208	0,6490	0,9039
3Y	1,0790	-22	-57	0,7400	0,8386	0,8698
4Y	1,0800	-31	-35	0,7709	0,9322	0,8640
5Y	1,0930	-19	-34	0,7970	0,8544	0,6746
7Y	1,4310	-7	-31	0,8164	0,9359	0,9512
10Y	1,2200	-16	-62	0,6265	0,9552	0,7473
15Y	1,6050	-9	-35	0,9451	0,9933	1,0012
20Y	1,6590	-13	-35	0,9722	1,0018	1,0787
30Y	1,3910	-14	-65	0,9214	0,9561	0,9962



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	36,34	-8,93	-18,46	OT 2Y	-0,323	0,07	6,70
JETFUEL	430,40	-36,55	-108,42	OT 5Y	0,032	0,10	12,50
DIESEL	421,33	-35,88	-91,30	OT 10Y	0,385	0,09	-16,00
COBRE	5.630,50	-67,00	-128,00	BUND 10Y	-1,287	-11,79	-27,80
ZINCO	1.967,00	-26,50	-245,25	SCHATZ 2Y	-0,376	-13,64	-6,90
OURO	1.669,68	-4,16	99,24	T-NOTE 10Y	1,715	-11,71	-28,40
TRIGO	520,00	4,25	-36,75	T-NOTE 2Y	0,902	-11,53	-16,00
LICENÇA C02	23,27	-0,15	-0,05	GILT 10Y	0,104	-5,53	-46,50


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1456	1,06%	4,61%	1,1500	1,1534	1,1605
EUR/GBP	0,87383	-0,25%	-3,15%	0,8764	0,8788	0,8838
EUR/JPY	117,12	1,67%	2,61%	117,12	117,12	117,12
EUR/CHF	1,0612	-0,25%	0,49%	1,0601	1,0589	1,0566
EUR/BRL	5,4298	-3,64%	-13,06%	5,4572	5,5203	5,6344
EUR/PLN	4,3183	-0,49%	-1,08%	4,3414	4,3613	4,3973


FIXINGS CONTRA USD e EUR

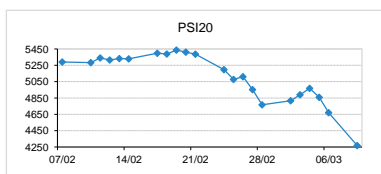
	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1456	0,8738	117,12	1,0612	10,7749	7,4659	1,5570	1,73199	5,4298	10,8776
USD	0,8747	-	0,7614	102,31	0,9264	9,4200	6,5315	1,3566	1,4998	4,7354	9,4824

ACCIONISTA

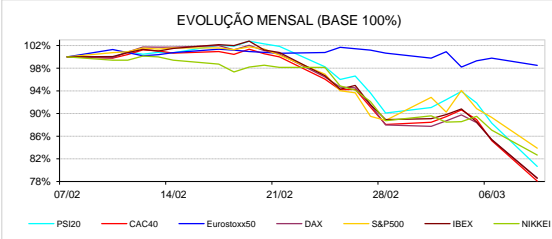
TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	4,114	-10,06	-27,57
BCP	0,120	-15,18	-40,78
CORT. AMORIM	9,110	-8,35	-19,38
CTT	2,042	-8,35	-35,99
EDP	4,056	-7,23	4,97
EDP R	11,800	-7,23	12,38
GALP	9,584	-16,52	-35,68
IBERSOL	7,300	-5,68	-8,75
J MARTINS	15,160	-5,46	3,38
MOTA ENGIL	1,020	-14,21	-45,45
NAVIGATOR	2,410	-9,53	-30,12
NOS	3,144	-6,60	-34,50
PHAROL	0,068	-12,82	-31,73
RAMADA	4,260	-6,17	-27,05
REN	2,480	-4,43	-8,82
SEMAPA	10,360	-5,65	-24,49
SONAE CAP.	0,578	-8,83	-23,24
SONAE SGPS	0,627	-8,87	-31,15

MAIORES GANHOS/PERDAS

Título	Variação %
ALTRI	-10,06
PHAROL	-12,82
MOTA ENGIL	-14,21
BCP	-15,18
GALP	-16,52



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.266,88	-8,66%	-18,17%	5.454,21	4.257,79
CAC40	4.707,91	-8,39%	-21,25%	6.111,41	4.691,20
ESTX 50 PR	2.959,07	-8,45%	-20,99%	3.867,28	2.939,85
XTRA DAX	10.625,02	-7,94%	-19,81%	13.795,24	10.556,64
S&P 500	2.791,43	-6,09%	-13,60%	3.393,52	2.722,27
IBEX 35	7.708,70	-7,96%	-19,27%	10.100,20	7.621,40
NIKKEI 225	19.698,76	-5,07%	-16,73%	24.115,95	19.472,26



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.