

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

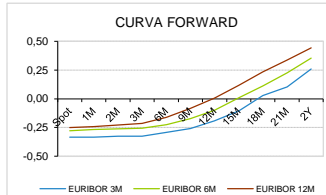
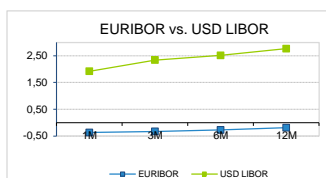
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

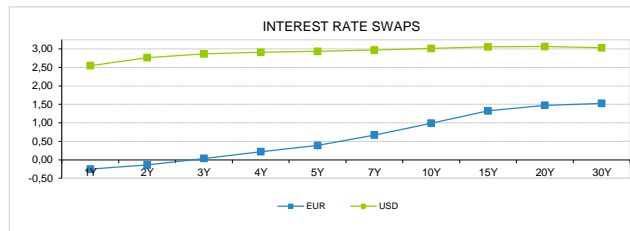
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	1,9187	0	2	0,4983	-0,7823
3M	-0,3260	0	0	3M	2,3425	-1	0	0,6461	-0,7196
6M	-0,2710	0	0	6M	2,5150	0	4	0,7563	-0,6452
12M	-0,1900	0	0	12M	2,7658	0	6	0,9284	-0,5170

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2505	0	1	0,0045	0,8429	1,3665
2Y	-0,1380	0	1	0,2229	0,9897	1,4586
3Y	0,0380	0	1	0,4274	1,1139	1,5447
4Y	0,2210	0	1	0,6025	1,2218	1,6222
5Y	0,3880	0	2	0,7520	1,3183	1,6840
7Y	0,6690	-1	3	0,9967	1,4820	1,7938
10Y	0,9910	-1	4	1,2682	1,6465	1,8926
15Y	1,3240	-1	5	1,5218	1,7789	1,9397
20Y	1,4750	-1	6	1,6275	1,8076	1,9055
30Y	1,5270	-1	6	1,6405	1,7580	1,8138

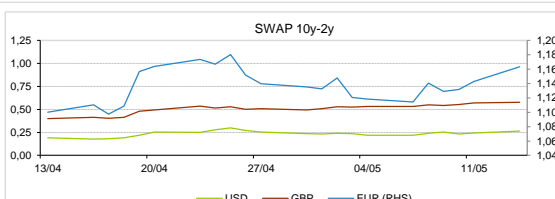
TAXA DE REFERENCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



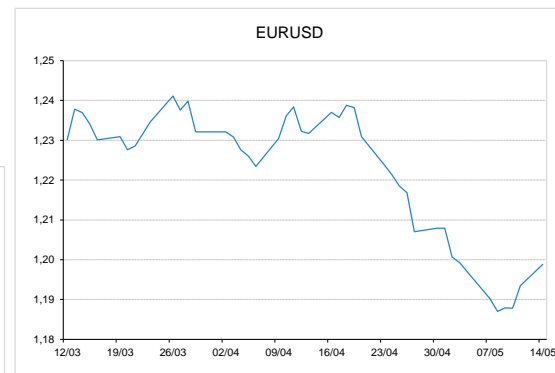
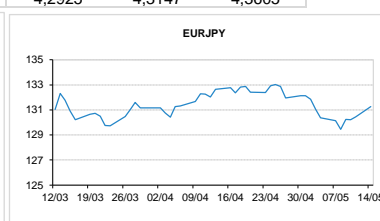
INTEREST RATE SWAPS						
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5500	-1	11	2,9800	3,0510	3,0370
2Y	2,7650	-1	15	3,0226	3,0595	3,0360
3Y	2,8650	0	18	3,0348	3,0602	3,0500
4Y	2,9110	0	19	3,0405	3,0335	3,0450
5Y	2,9370	0	20	3,0444	3,0460	3,1125
7Y	2,9700	0	20	3,0310	3,0680	3,0790
10Y	3,0140	0	21	3,0861	3,0870	3,1371
15Y	3,0550	0	20	3,0790	3,1207	3,0968
20Y	3,0640	0	19	3,0580	3,0790	3,0680
30Y	3,0290	0	18	3,0530	3,0175	3,0207



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	78,07	0,95	6,14	OT 2Y	-0,166	0,02	0,10
JETFUEL	734,00	6,00	39,83	OT 5Y	0,582	0,03	29,20
DIESEL	687,50	5,75	41,33	OT 10Y	1,715	0,04	1,60
COBRE	6.921,50	25,00	-8,00	BUND 10Y	0,134	4,71	8,00
ZINCO	3.064,50	-10,00	-173,25	SCHATZ 2Y	0,060	1,84	1,90
OURO	1.319,63	1,33	-25,80	T-NOTE 10Y	3,678	1,35	12,80
TRIGO	493,25	-5,50	4,00	T-NOTE 2Y	2,922	0,00	12,50
LICENÇA C02	14,62	-0,01	0,68	GILT 10Y	1,624	2,42	1,20


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1988	0,45%	-3,09%	1,2070	1,2157	1,2353
EUR/GBP	0,8824	-0,27%	-2,01%	0,8846	0,8872	0,8931
EUR/JPY	131,27	-0,63%	1,14%	131,27	131,27	131,27
EUR/CHF	1,1949	0,00%	-0,54%	1,1937	1,1925	1,1904
EUR/BRL	4,352	-1,20%	-2,75%	4,4186	4,4803	4,6203
EUR/PLN	4,2707	-0,10%	-2,75%	4,2925	4,3147	4,3605


FIXINGS CONTRA USD e EUR

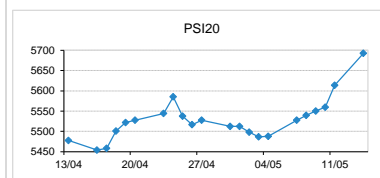
	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1988	0,8824	131,27	1,1949	10,3026	7,4500	1,5285	1,58595	4,3520	9,5801
USD	0,8356	-	0,7356	109,538	0,9982	8,6084	6,2257	1,2768	1,3239	3,6184	8,0013

ACCIONISTA

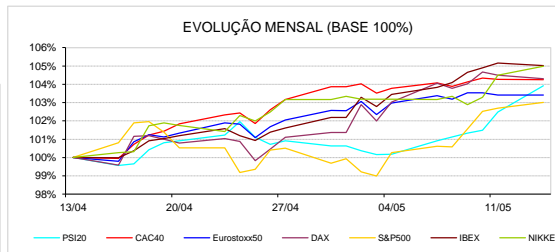
TITULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,390	4,07	23,57
BCP	0,294	-1,44	8,20
CORT. AMORIM	11,3800	0,18	10,49
CTT	3,2520	1,18	-7,27
EDP	3,400	9,32	17,85
EDP R	8,055	2,68	15,62
GALP	17,180	0,38	12,10
IBERSOL	11,400	-0,44	-6,17
J MARTINS	13,820	1,32	-14,67
MOTA ENGIL	3,590	-0,97	-1,99
NAVIGATOR	4,980	0,20	17,12
NOS	4,946	-0,68	-9,76
NOVABASE	2,810	1,08	-7,84
PHAROL	0,271	-0,73	8,20
REN	2,630	1,08	6,09
SEMAPA	18,980	-0,84	6,66
SONAE CAP.	1,016	0,00	14,54
SONAE SGPS	1,133	-0,87	0,62

MAIORES GANHOS/PERDAS

Título	Variação %
EDP	9,32
ALTRI	4,07
EDP R	2,68
J MARTINS	1,32
CTT	1,18
PHAROL	-0,73
SEMAPA	-0,84
SONAE SGPS	-0,87
MOTA ENGIL	-0,97
BCP	-1,44



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.692,66	1,40%	5,65%	5.793,38	5.014,62
CAC40	5.540,68	-0,02%	4,29%	5.567,03	4.995,07
ESTX 50 PR	3.565,74	0,01%	1,76%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.977,71	-0,18%	0,47%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.736,51	0,31%	2,34%	2.872,87	2.352,72
IBEX 35	10.257,80	-0,13%	2,13%	11.048,00	9.327,60
NIKKEI 225	22.865,86	0,47%	0,44%	24.129,34	19.239,52



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 incorreções 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, S.A. 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.