

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

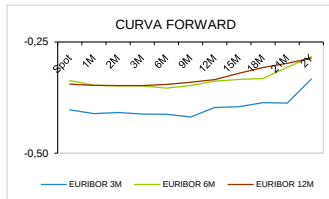
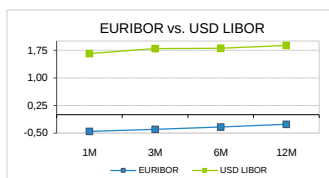
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

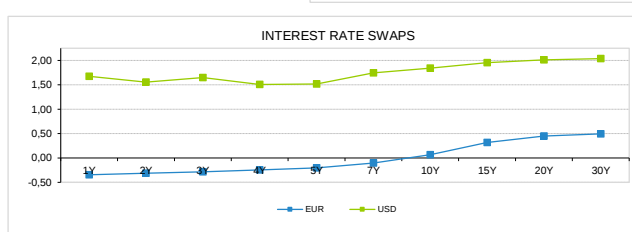
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4530	0	-1	1M	1,6595	0	-15	0,6306	-0,7586
3M	-0,3980	-1	-1	3M	1,7954	0	-17	0,6908	-0,6704
6M	-0,3330	-1	-1	6M	1,8053	-2	-12	0,7475	-0,6202
12M	-0,2600	0	-1	12M	1,8799	-1	-13	0,8044	-0,4946

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3450	-1	-2	-0,3353	-0,2260	-0,0251
2Y	-0,3140	-1	-1	-0,3103	-0,1850	0,0363
3Y	-0,2850	-1	-2	-0,2820	-0,1310	0,1031
4Y	-0,2470	-2	-3	-0,2480	-0,0733	0,1660
5Y	-0,2040	-2	-5	-0,2022	-0,0100	0,2235
7Y	-0,1040	-2	-7	-0,0955	0,1110	0,3366
10Y	0,0680	-2	-8	0,0734	0,2775	0,4636
15Y	0,3160	-3	-8	0,2940	0,4368	0,5603
20Y	0,4500	-3	-8	0,3991	0,4883	0,5627
30Y	0,4940	-2	-6	0,4120	0,4518	0,4809

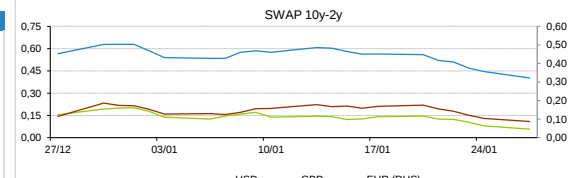
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



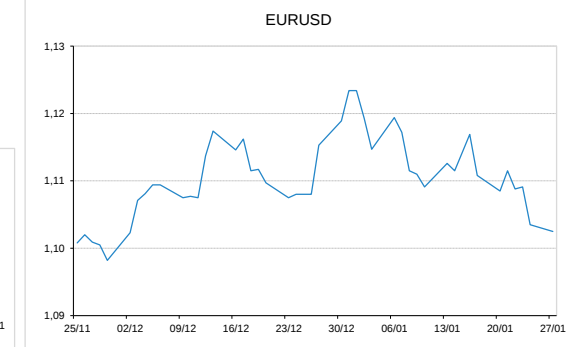
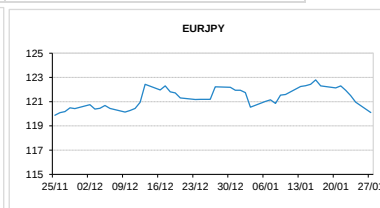
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,6750	0	-10	1,4382	1,3575	1,5210
2Y	1,5560	-1	-16	1,3175	1,4010	1,5600
3Y	1,6480	7	4	1,3370	1,6085	1,5950
4Y	1,5070	-2	-14	1,3630	1,5641	1,8077
5Y	1,5180	-3	-17	1,4110	1,5190	1,6824
7Y	1,7440	9	7	1,4768	1,6031	1,7190
10Y	1,8400	9	9	1,5560	1,6859	1,7863
15Y	1,9530	9	9	1,6590	1,7563	1,8090
20Y	2,0120	11	12	1,7110	1,7630	1,8095
30Y	2,0370	10	11	1,7200	1,7480	1,7670



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	58,87	-1,82	-8,00	OT 2Y	-0,441	-0,03	7,10
JETFUEL	581,99	-12,20	-74,01	OT 5Y	-0,109	-0,04	1,10
DIESEL	539,09	-11,91	-83,98	OT 10Y	0,306	-0,07	-11,00
COBRE	5.922,50	-61,00	-289,00	BUND 10Y	-1,013	-6,01	-18,70
ZINCO	2.347,00	-3,50	67,50	SCHATZ 2Y	0,000	-2,06	-1,40
OURO	1.581,91	10,38	71,35	T-NOTE 10Y	2,496	-5,46	-24,10
TRIGO	569,00	-4,50	12,75	T-NOTE 2Y	1,910	-3,81	-17,40
LICENÇA C02	24,62	0,24	-2,08	GILT 10Y	0,419	-5,88	-26,60


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1025	-0,09%	-1,15%	1,1087	1,1147	1,1265
EUR/GBP	0,84358	-0,05%	0,92%	0,8459	0,8482	0,8527
EUR/JPY	120,11	0,71%	1,77%	120,11	120,11	120,11
EUR/CHF	1,0684	0,20%	1,96%	1,0677	1,0669	1,0651
EUR/BRL	4,6565	-0,95%	-2,88%	4,6990	4,7434	4,8525
EUR/PLN	4,2787	-0,51%	-0,41%	4,3003	4,3233	4,3711


FIXINGS CONTRA USD e EUR

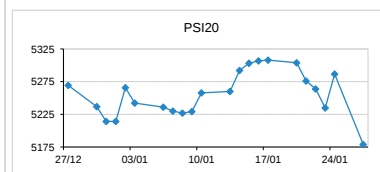
	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1025	0,8436	120,11	1,0684	10,5999	7,4729	1,4524	1,63073	4,6565	10,0735
USD	0,9080	-	0,7659	108,895	0,9697	9,6281	6,7854	1,3182	1,4798	4,2255	9,1430

ACCIONISTA

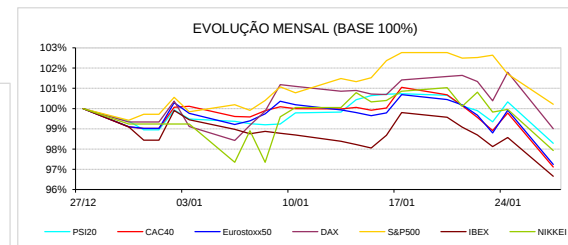
TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,760	-5,34	1,41
BCP	0,182	-4,11	-10,36
CORT. AMORIM	10,860	-1,63	-3,89
CTT	2,996	-4,59	-6,08
EDP	4,245	-1,35	9,86
EDP R	11,340	-0,53	8,00
GALP	13,780	-2,37	-7,52
IBERSOL	8,720	-0,68	9,00
J MARTINS	15,580	-1,49	6,24
MOTA ENGIL	1,696	-4,23	-9,30
NAVIGATOR	3,254	-2,52	-5,64
NOS	4,810	-1,19	0,21
NOVABASE	2,670	-1,11	3,49
PHAROL	0,102	-1,17	2,21
RAMADA	5,700	-0,70	-2,40
REN	12,600	-2,78	-8,16
SEMAPA	0,732	-5,30	-2,79
SONAE CAP.	0,841	-1,81	-7,58
SONAE SGPS	5,700	-0,70	-2,40

MAIORES GANHOS/PERDAS

Título	Variação %
BCP	-4,11
MOTA ENGIL	-4,23
CTT	-4,59
SEMAPA	-5,30
ALTRI	-5,34



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.178,89	-2,04%	-0,68%	5.429,32	4.699,20
CAC40	5.863,02	-2,68%	-1,92%	6.109,81	4.878,62
ESTX 50 PR	3.677,84	-2,68%	-1,80%	3.813,80	3.124,62
XTRA DAX	13.204,77	-2,74%	-0,33%	13.640,06	10.863,56
S&P 500	3.249,82	-1,47%	0,50%	3.337,77	2.624,06
IBEX 35	9.376,10	-1,94%	-1,81%	9.709,90	8.409,20
NIKKEI 225	23.343,51	-2,03%	-1,32%	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.