

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

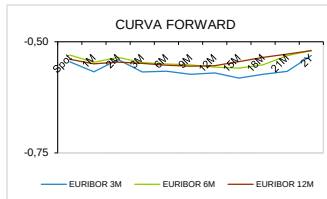
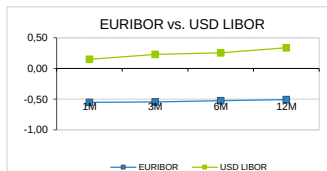
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

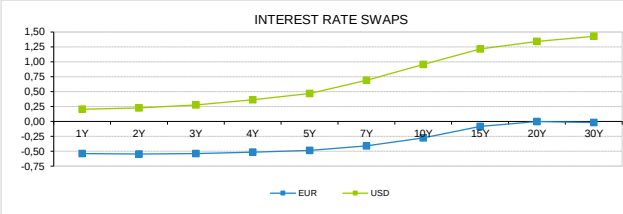
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5520	0	-1	1M	0,1488	0	2	0,0278	-0,8546
3M	-0,5450	-1	-3	3M	0,2300	0	2	0,0311	-0,7834
6M	-0,5240	-1	-1	6M	0,2534	0	1	0,0433	-0,7390
12M	-0,5070	0	-2	12M	0,3373	0	0	0,1095	-0,6212

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5393	0	-3	-0,5561	-0,4550	-0,2753
2Y	-0,5465	0	-3	-0,5368	-0,4128	-0,2250
3Y	-0,5378	0	-3	-0,5087	-0,3669	-0,1710
4Y	-0,5165	0	-4	-0,4741	-0,3180	-0,1200
5Y	-0,4873	0	-5	-0,4342	-0,2670	-0,0654
7Y	-0,4110	0	-7	-0,3430	-0,1650	0,0210
10Y	-0,2750	0	-8	-0,2000	-0,0360	0,1140
15Y	-0,0845	0	-10	-0,0319	0,0714	0,1570
20Y	-0,0020	0	-10	0,0267	0,0840	0,1260
30Y	-0,0180	0	-10	-0,0095	0,0110	0,0224

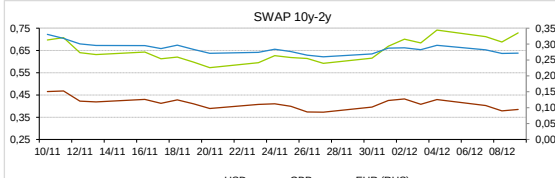
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2043	-1	-1	0,2449	0,5990	1,1340
2Y	0,2262	0	-3	0,3100	0,7520	1,2536
3Y	0,2755	1	-4	0,4172	0,8926	1,3280
4Y	0,3635	2	-4	0,5230	1,0048	1,4070
5Y	0,4683	2	-4	0,6596	1,0950	1,4671
7Y	0,6886	3	-3	0,8660	1,2230	1,5350
10Y	0,9547	4	-2	1,1111	1,3855	1,6067
15Y	1,2149	4	-1	1,3242	1,5040	1,6380
20Y	1,3422	4	0	1,3980	1,5751	1,6405
30Y	1,4279	4	1	1,4435	1,5602	1,6110

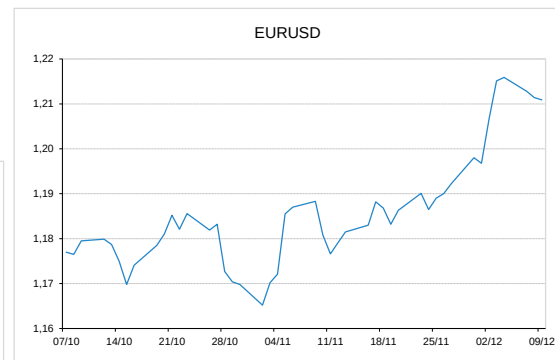
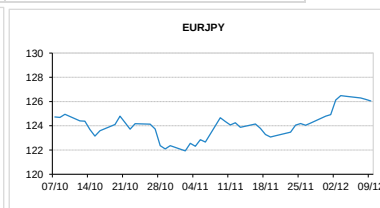
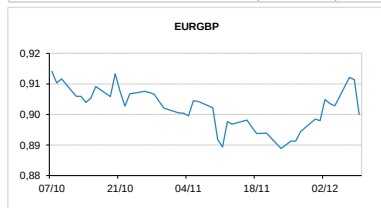


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	49,30	0,46	6,55	OT 2Y	-0,723	0,00	-12,20
JETFUEL	419,90	2,90	89,69	OT 5Y	-0,471	-0,01	-10,20
DIESEL	406,90	2,40	82,69	OT 10Y	-0,017	-0,01	-16,80
COBRE	7.710,50	-11,00	752,50	BUND 10Y	-1,277	0,86	-10,20
ZINCO	2.775,25	12,25	150,35	SCHATZ 2Y	-0,192	0,68	-3,20
OURO	1.841,49	-31,44	-20,81	T-NOTE 10Y	1,865	2,27	-3,70
TRIGO	580,50	10,50	-25,00	T-NOTE 2Y	0,754	0,56	-2,20
LICENÇA C02	29,70	0,13	3,15	GILT 10Y	0,444	0,43	-12,20



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2109	-0,04%	1,90%	1,2138	1,2163	1,2216
EUR/GBP	0,9	1,27%	0,25%	0,9014	0,9029	0,9060
EUR/JPY	126,05	0,10%	-1,09%	126,05	126,05	126,05
EUR/CHF	1,0750	0,14%	0,26%	1,0744	1,0737	1,0723
EUR/BRL	6,2296	-0,50%	2,04%	6,2575	6,2936	6,4126
EUR/PLN	4,4315	0,47%	1,23%	4,4401	4,4490	4,4686



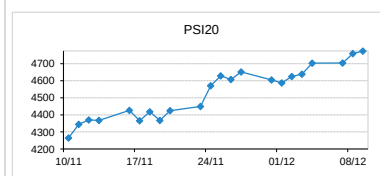
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2109	0,9000	126,05	1,0750	10,2578	7,4432	1,5455	1,62103	6,2296	10,6599
USD	0,8276	-	0,7464	104,195	0,8899	8,4916	6,1602	1,2805	1,3404	5,1267	8,8141

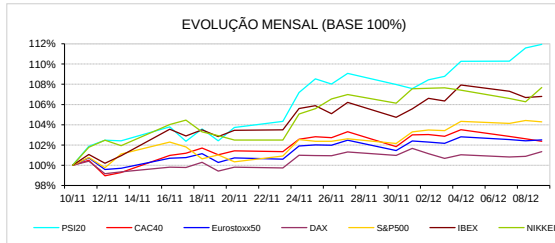
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,220	2,96	-8,10
BCP	0,129	1,74	-36,54
CORT. AMORIM	10,380	0,58	-8,14
CTT	2,550	0,20	-20,06
EDP	4,687	0,51	24,11
EDP R	18,500	-0,96	76,19
GALP	9,162	-0,59	-38,51
IBERSOL	5,160	0,78	-35,50
J MARTINS	14,375	0,88	-1,98
MOTA ENGIL	1,436	2,57	-23,21
NAVIGATOR	2,494	0,81	-23,55
NOS	3,244	-1,28	-32,42
PHAROL	0,132	0,30	32,53
RAMADA	3,720	0,81	-36,30
REN	2,340	0,65	-13,97
SEMAPA	9,670	0,73	-29,52
SONAE CAP.	#N/A Real	#N/A	2,26
SONAE SGPS	0,703	0,57	-22,75

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	2,96
MOTA ENGIL	2,57
BCP	1,74
J MARTINS	0,88
RAMADA	0,81
GALP	-0,59
EDP R	-0,96
NOS	-1,28



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.774,19	0,32%	-8,44%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.546,82	-0,25%	-7,21%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.529,02	0,09%	-5,77%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.340,26	0,47%	0,69%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.697,67	-0,12%	14,46%	3.712,39	2.191,86
IBEX 35	8.235,30	0,09%	-13,76%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	26.817,94	1,33%	13,36%	26.894,25	16.358,19



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.