

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

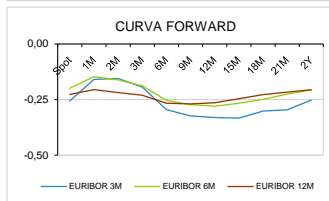
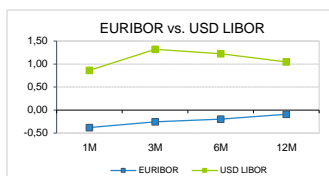
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

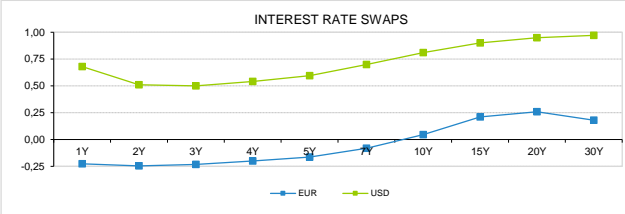
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3790	3	12	1M	0,8635	-6	0	0,2274	-0,7440
3M	-0,2540	4	22	3M	1,3199	-3	42	0,6650	-0,6030
6M	-0,1960	4	23	6M	1,2245	-1	34	0,7273	-0,5384
12M	-0,0900	3	26	12M	1,0448	0	20	0,8326	-0,4204

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2267	2	25	-0,2640	-0,1130	0,0735
2Y	-0,2458	1	25	-0,2350	-0,0619	0,1218
3Y	-0,2320	1	26	-0,1968	-0,0168	0,1669
4Y	-0,2000	0	28	-0,1503	0,0299	0,2091
5Y	-0,1628	0	29	-0,1053	0,0755	0,2460
7Y	-0,0810	-1	32	-0,0138	0,1620	0,3216
10Y	0,0458	-1	36	0,1135	0,2690	0,3936
15Y	0,2104	-1	39	0,2514	0,3393	0,3965
20Y	0,2588	-1	38	0,2741	0,3120	0,3269
30Y	0,1804	-2	32	0,1750	0,1829	0,1786

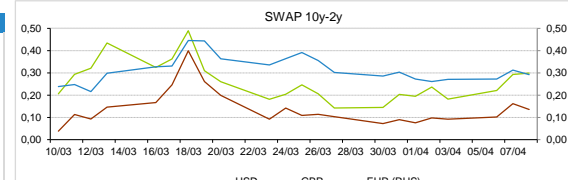
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,75
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,6805	0	15	0,3824	0,6170	0,9109
2Y	0,5107	-2	2	0,4171	0,7384	0,9592
3Y	0,5003	-3	-1	0,5007	0,7960	0,9896
4Y	0,5405	-4	1	0,5768	0,8479	1,0084
5Y	0,5951	-4	4	0,6516	0,8770	1,0308
7Y	0,6988	-3	12	0,7020	0,9453	1,0444
10Y	0,8100	-1	21	0,8393	0,9770	1,0595
15Y	0,9005	-1	29	0,9155	1,0120	1,0250
20Y	0,9487	-1	33	0,9280	0,9885	1,0160
30Y	0,9710	-1	38	0,9495	0,9998	1,0084

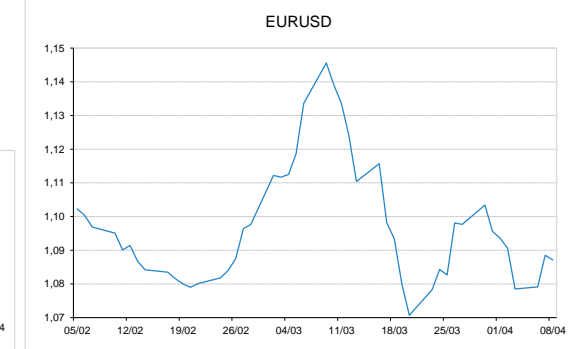
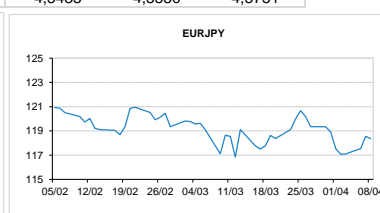


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	32,14	0,27	-13,38	OT 2Y	0,046	0,02	36,90
JETFUEL	230,00	-17,15	-200,40	OT 5Y	0,507	0,01	47,50
DIESEL	293,47	-13,40	-127,86	OT 10Y	0,975	0,03	59,00
COBRE	5.024,00	156,00	-567,00	BUND 10Y	-0,751	0,70	53,10
ZINCO	1.916,50	20,75	-56,50	SCHATZ 2Y	-0,005	1,15	36,70
OURO	1.650,97	-1,12	-22,86	T-NOTE 10Y	1,831	-0,28	13,70
TRIGO	548,50	-0,75	32,75	T-NOTE 2Y	0,880	-3,34	3,90
LICENÇA C02	21,01	0,50	-2,41	GILT 10Y	0,347	-0,60	23,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0871	-0,13%	-5,11%	1,0902	1,0930	1,0988
EUR/GBP	0,87948	0,16%	-0,64%	0,8812	0,8830	0,8870
EUR/JPY	118,36	0,16%	-1,05%	118,36	118,36	118,36
EUR/CHF	1,0550	0,25%	0,53%	1,0543	1,0536	1,0521
EUR/BRL	5,6128	1,38%	-3,71%	5,6506	5,6767	5,7249
EUR/PLN	4,5294	-0,08%	-4,45%	4,5435	4,5550	4,5751



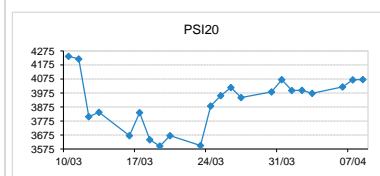
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0871	0,8795	118,36	1,0550	10,9191	7,4626	1,5227	1,74586	5,6128	11,1569
USD	0,9207	-	0,808	108,735	0,9713	10,0574	6,8701	1,4062	1,6110	5,1911	10,2799

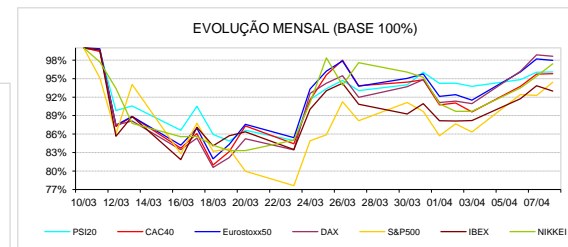
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	4,128	0,49	-27,32
BCP	0,099	1,86	-51,43
CORT. AMORIM	8,250	-0,96	-26,99
CTT	2,285	2,01	-28,37
EDP	3,599	-0,19	-6,86
EDP R	10,440	0,58	-0,57
GALP	9,970	-0,55	-33,09
IBERSOL	4,550	-2,15	-43,13
J MARTINS	15,170	-2,13	3,44
MOTA ENGIL	1,300	4,50	-30,48
NAVIGATOR	2,326	0,43	-32,55
NOS	3,118	-0,26	-35,04
PHAROL	0,067	0,00	-33,23
RAMADA	2,870	-2,05	-50,86
REN	2,400	0,00	-11,76
SEMAPA	8,840	1,14	-35,57
SONAE CAP.	0,468	0,21	-37,85
SONAE SGPS	0,672	0,67	-26,21

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	4,50
CTT	2,01
BCP	1,86
SEMAPA	1,14
SONAE SGPS	0,67
GALP	-0,55
CORT. AMORIM	-0,96
RAMADA	-2,05
J MARTINS	-2,13
IBERSOL	-2,15



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.071,37	0,05%	-21,92%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.442,75	0,10%	-25,68%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.850,69	-0,24%	-23,88%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	10.332,89	-0,23%	-22,01%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.720,54	2,30%	-15,79%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.938,30	-0,91%	-27,34%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	19.353,24	2,13%	-18,19%	24.115,95	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.