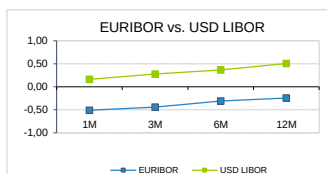


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

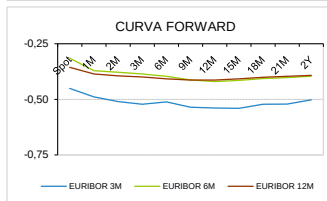
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5080	-1	-3	1M	0,1626	0	-1	0,0753
3M	-0,4410	-1	-9	3M	0,2759	-3	-5	0,1120
6M	-0,3080	1	-11	6M	0,3663	0	-11	0,3048
12M	-0,2430	-1	-12	12M	0,5056	-3	-12	0,4216

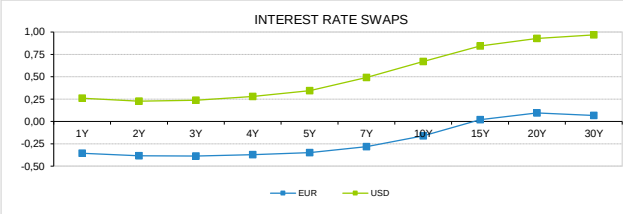


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3552	0	-8	-0,4132	-0,3269	-0,1752
2Y	-0,3842	1	-7	-0,4026	-0,2896	-0,1201
3Y	-0,3869	0	-7	-0,3776	-0,2511	-0,0711
4Y	-0,3720	0	-8	-0,3462	-0,2041	-0,0227
5Y	-0,3480	0	-8	-0,3118	-0,1582	0,0250
7Y	-0,2825	0	-10	-0,2277	-0,0638	0,1112
10Y	-0,1604	0	-12	-0,0971	0,0623	0,2038
15Y	0,0200	0	-12	0,0648	0,1616	0,2437
20Y	0,0950	0	-12	0,1166	0,1653	0,2030
30Y	0,0666	0	-10	0,0736	0,0911	0,1010

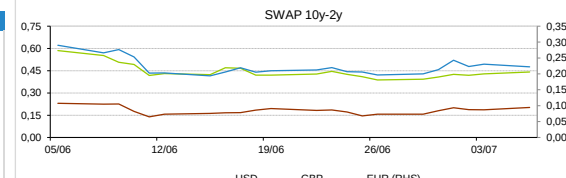
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,25
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2600	0	-5	0,1889	0,4081	0,8009
2Y	0,2265	0	-7	0,2096	0,5069	0,8380
3Y	0,2372	0	-9	0,2864	0,6037	0,9070
4Y	0,2796	0	-12	0,3582	0,6854	0,9676
5Y	0,3441	0	-13	0,4499	0,7537	1,0077
7Y	0,4915	0	-16	0,5862	0,8607	1,0355
10Y	0,6700	0	-18	0,7641	0,9400	1,0600
15Y	0,8431	0	-18	0,8868	1,0190	1,0945
20Y	0,9275	0	-19	0,9519	1,0506	1,1118
30Y	0,9680	0	-19	0,9886	1,0384	1,0656

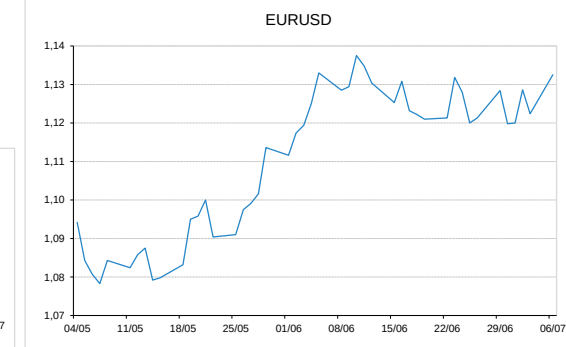
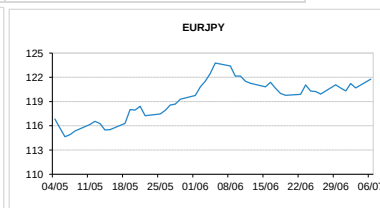
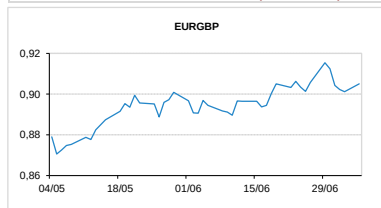


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	43,23	0,43	0,81	OT 2Y	-0,485	-0,01	-11,80
JETFUEL	347,52	2,98	21,14	OT 5Y	-0,114	-0,02	-12,60
DIESEL	374,25	4,26	34,86	OT 10Y	0,416	-0,02	-11,10
COBRE	6.015,00	-56,00	492,50	BUND 10Y	-1,133	0,20	-16,80
ZINCO	2.016,50	-17,01	-1,50	SCHATZ 2Y	-0,046	0,46	-5,70
OURO	1.783,76	0,27	98,70	T-NOTE 10Y	1,745	1,83	-9,90
TRIGO	492,50	0,50	-27,75	T-NOTE 2Y	0,761	0,93	-3,00
LICENÇA C02	29,70	1,79	6,46	GILT 10Y	0,231	1,61	-11,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1325	0,90%	0,35%	1,1348	1,1376	1,1422
EUR/GBP	0,90505	-0,43%	-1,47%	0,9064	0,9080	0,9112
EUR/JPY	121,78	-0,90%	1,34%	121,78	121,78	121,78
EUR/CHF	1,0653	-0,23%	1,53%	1,0646	1,0637	1,0625
EUR/BRL	6,0559	-1,29%	-10,12%	6,0886	6,1181	6,1793
EUR/PLN	4,4660	-0,09%	-0,98%	4,4739	4,4828	4,5004



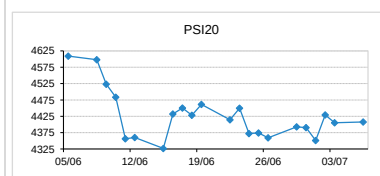
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1325	0,9051	121,78	1,0653	10,4677	7,4512	1,5326	1,62189	6,0559	10,6238
USD	0,8835	-	0,7994	107,465	0,9397	9,2546	6,5834	1,3534	1,4315	5,3028	9,3760

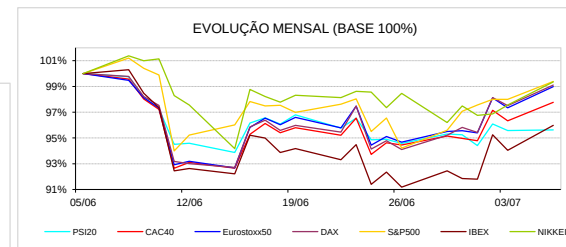
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,372	2,15	-23,03
BCP	0,110	1,85	-45,76
CORT. AMORIM	9,980	-0,80	-11,68
CTT	2,200	4,02	-31,03
EDP	4,345	-2,40	12,45
EDP R	12,540	-2,18	19,43
GALP	10,550	1,59	-29,19
IBERSOL	5,100	-1,16	-36,25
J MARTINS	14,880	-0,50	1,47
MOTA ENGIL	1,194	5,11	-36,15
NAVIGATOR	2,198	1,57	-36,26
NOS	3,638	0,78	-24,21
PHAROL	0,102	-0,20	2,01
RAMADA	3,820	1,60	-34,59
REN	2,460	-1,20	-9,56
SEMAPA	8,330	2,08	-39,29
SONAE CAP.	0,520	1,17	-30,94
SONAE SGPS	0,646	0,94	-29,01

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	5,11
CTT	4,02
ALTRI	2,15
SEMAPA	2,08
BCP	1,85
CORT. AMORIM	-0,80
IBERSOL	-1,16
REN	-1,20
EDP R	-2,18
EDP	-2,40



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.407,48	0,05%	-15,47%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.081,51	1,49%	-15,00%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.350,03	1,69%	-10,55%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.733,45	1,64%	-3,89%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.174,27	1,42%	-1,75%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.556,20	2,06%	-20,87%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.714,44	1,83%	-3,98%	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.