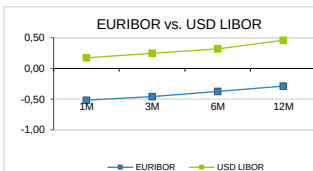


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

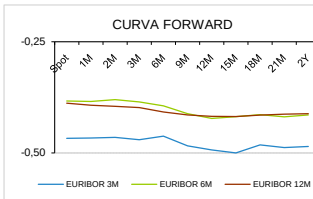
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5160	0	-1	1M	0,1726	0	-1	0,0680
3M	-0,4570	-1	-5	3M	0,2468	0	-4	0,0843
6M	-0,3750	0	-9	6M	0,3185	-1	-6	0,1763
12M	-0,2880	0	-9	12M	0,4595	0	-10	0,3153

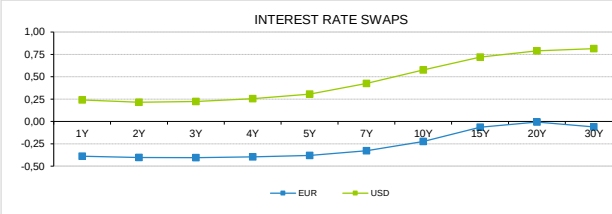


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3885	0	-5	-0,4178	-0,3704	-0,2460
2Y	-0,4031	-1	-2	-0,4147	-0,3445	-0,2045
3Y	-0,4053	-1	-2	-0,4006	-0,3115	-0,1570
4Y	-0,3963	-1	-2	-0,3800	-0,2736	-0,1151
5Y	-0,3796	-2	-3	-0,3528	-0,2338	-0,0748
7Y	-0,3286	-3	-4	-0,2851	-0,1477	0,0043
10Y	-0,2250	-3	-4	-0,1680	-0,0336	0,0877
15Y	-0,0655	-4	-6	-0,0280	0,0493	0,1141
20Y	-0,0070	-4	-7	0,0084	0,0418	0,0642
30Y	-0,0610	-4	-7	-0,0581	-0,0510	-0,0521

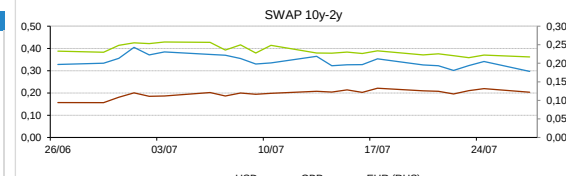
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,25
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2410	0	-2	0,1844	0,3513	0,6710
2Y	0,2148	0	-1	0,2131	0,4328	0,7307
3Y	0,2225	0	-1	0,2596	0,5020	0,7690
4Y	0,2546	0	-1	0,3206	0,5720	0,8225
5Y	0,3056	0	-1	0,3913	0,6404	0,8563
7Y	0,4255	-1	-2	0,5152	0,7334	0,9049
10Y	0,5763	-1	-3	0,6539	0,8187	0,9384
15Y	0,7190	-1	-5	0,7726	0,8750	0,9657
20Y	0,7903	0	-6	0,8247	0,8983	0,9350
30Y	0,8141	0	-7	0,8284	0,8640	0,8790

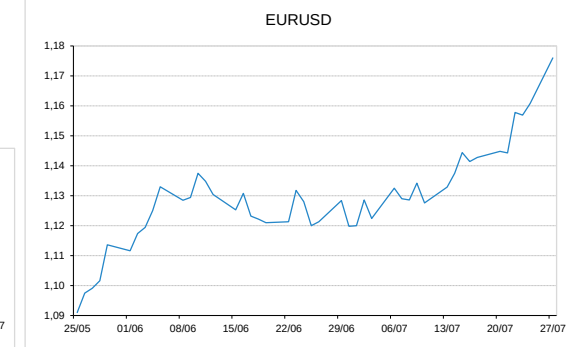
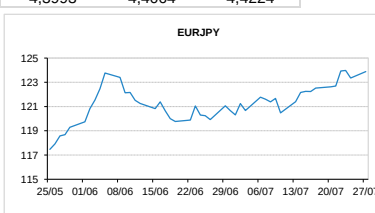


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	42,45	-0,89	1,52	OT 2Y	-0,441	0,00	2,80
JETFUEL	355,00	-0,25	27,50	OT 5Y	-0,152	0,01	-5,80
DIESEL	379,50	-0,50	32,75	OT 10Y	0,349	-0,01	-11,60
COBRE	6.400,00	-129,50	550,00	BUND 10Y	-1,191	-5,13	-2,00
ZINCO	2.217,50	-21,25	185,00	SCHATZ 2Y	-0,032	-1,38	3,70
OURO	1.939,91	37,89	168,62	T-NOTE 10Y	1,678	-0,56	-6,50
TRIGO	530,50	-9,00	54,75	T-NOTE 2Y	0,744	0,19	-2,80
LICENÇA C02	25,04	-1,33	0,31	GILT 10Y	0,136	-3,86	-5,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,176	1,31%	4,22%	1,1783	1,1810	1,1854
EUR/GBP	0,9134	-0,39%	0,22%	0,9147	0,9162	0,9189
EUR/JPY	123,88	-0,42%	-2,27%	123,88	123,88	123,88
EUR/CHF	1,0816	-0,79%	-1,14%	1,0809	1,0801	1,0786
EUR/BRL	6,0885	0,25%	-0,12%	6,1149	6,1441	6,2146
EUR/PLN	4,3936	0,31%	1,44%	4,3993	4,4064	4,4224



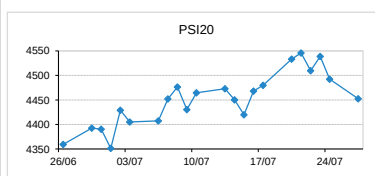
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1760	0,9134	123,88	1,0816	10,2750	7,4432	1,5739	1,64804	6,0885	10,7075
USD	0,8492	-	0,7755	105,145	0,9191	8,7211	6,3210	1,3371	1,3991	5,1592	9,0853

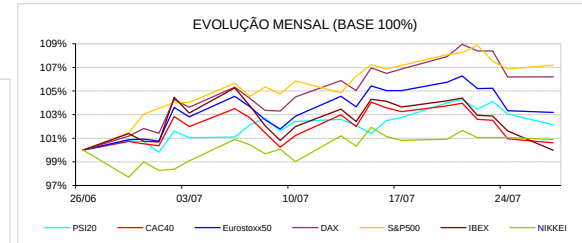
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,286	-0,42	-24,54
BCP	0,101	-2,89	-50,25
CORT. AMORIM	9,890	2,49	-12,48
CTT	2,255	-0,66	-29,31
EDP	4,419	-0,67	17,01
EDP R	14,020	-0,14	33,52
GALP	10,125	-2,17	-32,05
IBERSOL	5,560	-0,36	-30,50
J MARTINS	14,370	-0,03	-2,01
MOTA ENGIL	1,196	-2,13	-36,04
NAVIGATOR	2,188	-1,71	-36,55
NOS	3,988	-1,19	-16,92
PHAROL	0,111	-0,36	11,45
RAMADA	3,300	0,00	-43,49
REN	2,485	0,20	-8,64
SEMAPA	7,980	-1,48	-41,84
SONAE CAP.	0,491	-2,19	-34,79
SONAE SGPS	0,623	-1,58	-31,54

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	2,49
REN	0,20
NAVIGATOR	-1,71
MOTA ENGIL	-2,13
GALP	-2,17
SONAE CAP.	-2,19
BCP	-2,89



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.452,41	-0,89%	-14,61%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.939,62	-0,34%	-17,37%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.306,39	-0,14%	-11,72%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.838,66	0,00%	-3,10%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.226,20	0,30%	-0,17%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.176,90	-1,61%	-24,84%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.715,85	-0,16%	-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.