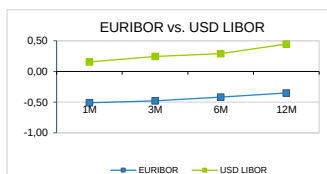


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

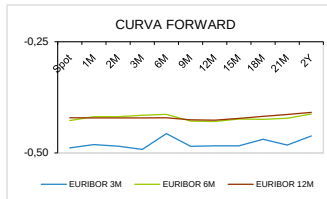
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATE								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5100	0	0	1M	0,1554	0	-1	0,0621
3M	-0,4780	0	-4	3M	0,2433	0	-3	0,0746
6M	-0,4180	0	-11	6M	0,2891	-1	-8	0,1256
12M	-0,3500	-1	-9	12M	0,4464	0	-7	0,2961

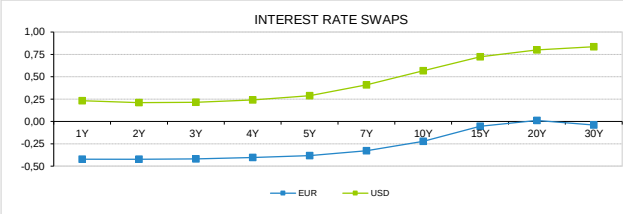


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4220	0	-7	-0,4263	-0,3596	-0,2304
2Y	-0,4230	1	-4	-0,4175	-0,3287	-0,1963
3Y	-0,4183	1	-4	-0,3981	-0,2958	-0,1564
4Y	-0,4035	1	-4	-0,3729	-0,2628	-0,1132
5Y	-0,3823	1	-4	-0,3443	-0,2252	-0,0640
7Y	-0,3280	2	-5	-0,2797	-0,1408	0,0167
10Y	-0,2220	2	-6	-0,1615	-0,0240	0,1049
15Y	-0,0536	2	-7	-0,0135	0,0690	0,1361
20Y	0,0110	2	-8	0,0278	0,0635	0,0869
30Y	-0,0410	2	-9	-0,0403	-0,0332	-0,0311

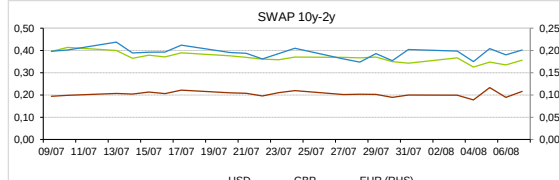
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2310	1	-2	0,1919	0,3123	0,6476
2Y	0,2102	2	-1	0,1893	0,3944	0,6780
3Y	0,2148	2	-1	0,2441	0,4744	0,7165
4Y	0,2407	2	-2	0,2999	0,5225	0,8150
5Y	0,2872	3	-3	0,3620	0,6183	0,8530
7Y	0,4081	3	-5	0,4670	0,6845	0,8740
10Y	0,5661	4	-6	0,6466	0,7870	0,9125
15Y	0,7236	4	-7	0,7485	0,8600	0,9445
20Y	0,7999	4	-8	0,8370	0,8800	0,9365
30Y	0,8356	5	-8	0,8160	0,8860	0,9091

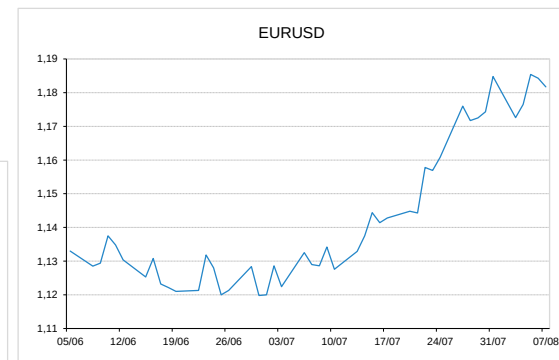
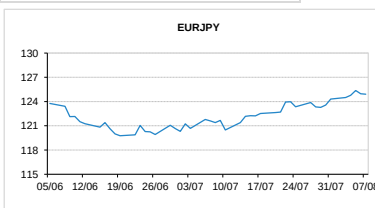
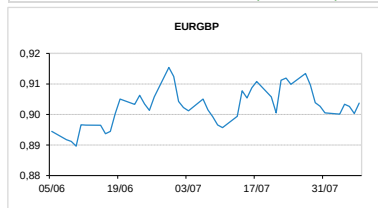


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	44,48	-0,61	1,22	OT 2Y	-0,447	0,01	3,80
JETFUEL	354,64	-3,95	6,22	OT 5Y	-0,203	0,00	-8,80
DIESEL	378,89	-3,20	3,72	OT 10Y	0,299	-0,01	-10,80
COBRE	6.486,00	-16,00	350,00	BUND 10Y	-1,211	2,98	-6,80
ZINCO	2.400,50	-0,25	343,50	SCHATZ 2Y	-0,041	1,60	-0,90
OURO	2.032,09	-28,50	236,27	T-NOTE 10Y	1,648	1,67	-7,00
TRIGO	492,50	-8,75	-2,75	T-NOTE 2Y	0,730	1,29	-1,80
LICENÇA C02	26,41	0,02	-2,98	GILT 10Y	0,168	4,11	-3,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1817	-0,22%	4,67%	1,1840	1,1865	1,1909
EUR/GBP	0,90373	-0,38%	-0,25%	0,9051	0,9065	0,9095
EUR/JPY	124,91	0,04%	-2,64%	124,91	124,91	124,91
EUR/CHF	1,0764	0,46%	-1,25%	1,0757	1,0749	1,0736
EUR/BRL	6,399	-1,01%	-5,16%	6,4274	6,4544	6,5227
EUR/PLN	4,4108	0,02%	1,46%	4,4165	4,4233	4,4382



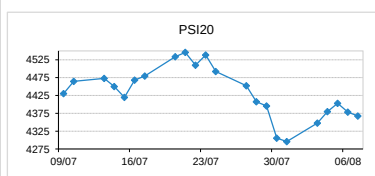
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1817	0,9037	124,91	1,0764	10,3033	7,4473	1,5771	1,64371	6,3990	10,6622
USD	0,8483	-	0,7663	105,885	0,9128	8,7415	6,3175	1,3382	1,3930	5,4352	9,0535

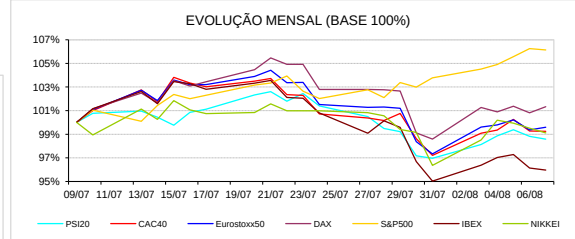
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,370	-0,32	-23,06
BCP	0,102	0,10	-49,85
CORT. AMORIM	10,300	3,41	-8,85
CTT	2,525	0,60	-20,85
EDP	4,357	-1,20	15,37
EDP R	14,000	0,72	33,33
GALP	9,178	-1,42	-38,40
IBERSOL	5,200	-1,89	-35,00
J MARTINS	14,160	0,07	-3,44
MOTA ENGIL	1,256	0,32	-32,83
NAVIGATOR	2,188	-0,55	-36,55
NOS	3,650	-1,19	-23,96
PHAROL	0,115	-0,52	15,26
RAMADA	3,480	9,78	-40,41
REN	2,450	0,20	-9,93
SEMAPA	7,890	-1,00	-42,49
SONAE CAP.	0,664	0,00	-11,82
SONAE SGPS	0,598	-0,42	-34,34

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
RAMADA	9,78
CORT. AMORIM	3,41
EDP R	0,72
CTT	0,60
MOTA ENGIL	0,32
SEMAPA	-1,00
NOS	-1,19
EDP	-1,20
GALP	-1,42
IBERSOL	-1,89



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.367,30	-0,25%	-16,24%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.883,73	-0,03%	-18,31%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.247,81	0,23%	-13,28%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.655,32	0,51%	-4,48%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.345,49	-0,11%	3,55%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.945,40	-0,18%	-27,27%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.329,94	-0,39%	-5,61%	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.