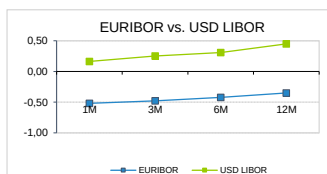


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

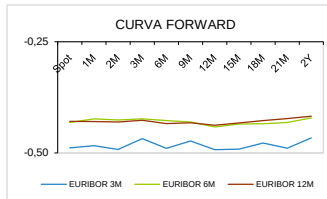
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5190	-1	-2	1M	0,1634	1	-2	0,0608
3M	-0,4780	0	-4	3M	0,2525	1	-2	0,0726
6M	-0,4220	0	-9	6M	0,3091	2	-5	0,1240
12M	-0,3500	0	-7	12M	0,4490	0	-4	0,2866

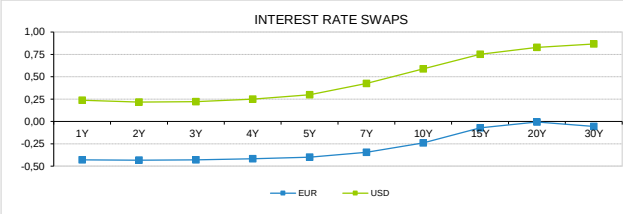


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4290	-1	-6	-0,4381	-0,3844	-0,2532
2Y	-0,4335	-1	-4	-0,4294	-0,3560	-0,2143
3Y	-0,4291	-1	-4	-0,4131	-0,3248	-0,1740
4Y	-0,4170	-2	-4	-0,3924	-0,2876	-0,1315
5Y	-0,3991	-2	-4	-0,3644	-0,2463	-0,0830
7Y	-0,3462	-2	-5	-0,2982	-0,1634	-0,0038
10Y	-0,2400	-2	-5	-0,1809	-0,0447	0,0861
15Y	-0,0713	-2	-5	-0,0315	0,0515	0,1184
20Y	-0,0062	-2	-5	0,0101	0,0457	0,0703
30Y	-0,0562	-2	-5	-0,0558	-0,0484	-0,0464

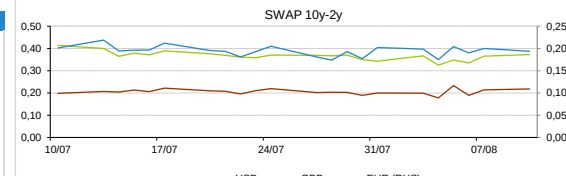
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2373	1	-1	0,1957	0,3227	0,6535
2Y	0,2164	0	0	0,2132	0,4070	0,7444
3Y	0,2206	0	-1	0,2512	0,4770	0,7920
4Y	0,2491	0	-3	0,3106	0,5670	0,8460
5Y	0,2981	0	-4	0,3826	0,6443	0,8861
7Y	0,4243	1	-5	0,5140	0,7485	0,9280
10Y	0,5885	1	-4	0,6615	0,8488	0,9690
15Y	0,7501	1	-3	0,8049	0,9245	1,0182
20Y	0,8288	2	-2	0,8645	0,9464	0,9910
30Y	0,8662	2	-1	0,8750	0,9170	0,9401

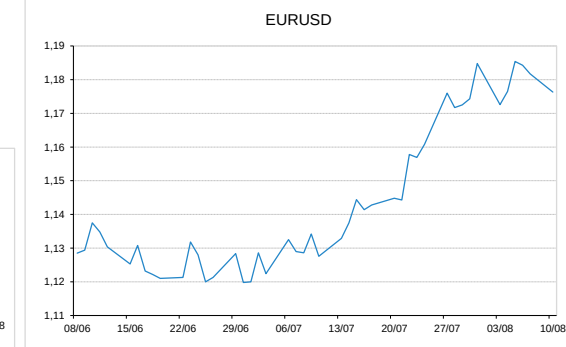
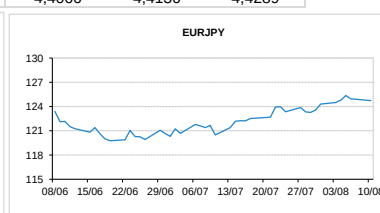


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	45,06	0,66	1,60	OT 2Y	-0,465	-0,02	0,60
JETFUEL	345,51	-9,13	-2,60	OT 5Y	-0,226	-0,02	-12,00
DIESEL	371,76	-7,13	0,15	OT 10Y	0,272	-0,03	-14,50
COBRE	6.237,00	-170,50	120,00	BUND 10Y	-1,231	-1,92	-6,20
ZINCO	2.392,25	-8,25	329,00	SCHATZ 2Y	-0,060	-1,37	-1,90
OURO	2.033,18	-2,37	234,48	T-NOTE 10Y	1,654	0,42	-3,60
TRIGO	490,50	-5,00	-43,50	T-NOTE 2Y	0,730	0,18	-1,40
LICENÇA C02	26,56	0,14	-2,46	GILT 10Y	0,157	-1,18	-2,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1763	-0,46%	4,32%	1,1785	1,1811	1,1857
EUR/GBP	0,90155	0,24%	-0,65%	0,9029	0,9044	0,9073
EUR/JPY	124,74	0,14%	-3,42%	124,74	124,74	124,74
EUR/CHF	1,0759	-0,04%	-1,15%	1,0752	1,0744	1,0732
EUR/BRL	6,3714	0,59%	-5,60%	6,3998	6,4281	6,4953
EUR/PLN	4,4009	0,28%	1,49%	4,4066	4,4136	4,4289



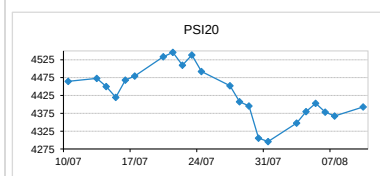
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1763	0,9016	124,74	1,0759	10,2795	7,4464	1,5697	1,64215	6,3714	10,6206
USD	0,8500	-	0,7641	105,78	0,9146	8,7403	6,3282	1,3350	1,3968	5,4033	9,0260

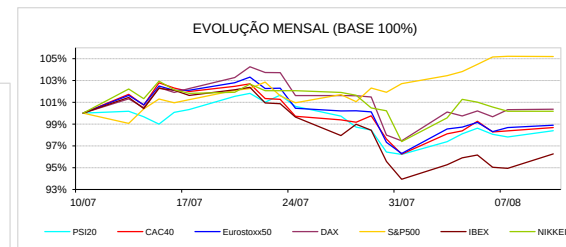
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,418	1,01	-22,22
BCP	0,103	1,88	-49,11
CORT. AMORIM	10,540	2,13	-6,73
CTT	2,690	6,53	-15,67
EDP	4,354	-0,55	15,29
EDP R	14,040	0,29	33,71
GALP	9,304	1,66	-37,56
IBERSOL	5,180	-1,15	-35,25
J MARTINS	14,080	-0,53	-3,99
MOTA ENGIL	1,280	2,07	-31,55
NAVIGATOR	2,222	1,55	-35,57
NOS	3,612	-1,10	-24,75
PHAROL	0,116	1,40	16,06
RAMADA	3,450	-0,86	-40,92
REN	2,450	0,20	-9,93
SEMAPA	7,970	1,01	-41,91
SONAE CAP.	0,666	0,30	-11,55
SONAE SGPS	0,599	0,08	-34,23

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	6,53
CORT. AMORIM	2,13
MOTA ENGIL	2,07
BCP	1,88
GALP	1,66
J MARTINS	-0,53
EDP	-0,55
RAMADA	-0,86
NOS	-1,10
IBERSOL	-1,15



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.393,14	0,59%	-15,75%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.905,04	0,32%	-17,95%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.259,71	0,22%	-12,96%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.679,57	0,04%	-4,30%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.350,60	-0,02%	3,71%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.047,50	1,40%	-26,20%	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.