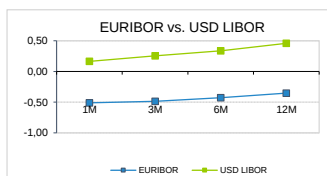


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

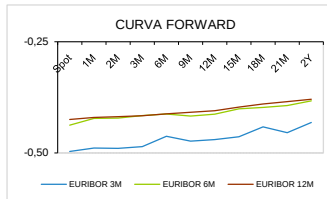
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5110	0	-1	1M	0,1641	0	-1	0,0606
3M	-0,4860	0	-5	3M	0,2535	0	-1	0,0674
6M	-0,4280	0	-10	6M	0,3369	0	-1	0,1246
12M	-0,3530	0	-7	12M	0,4581	0	-2	0,2866

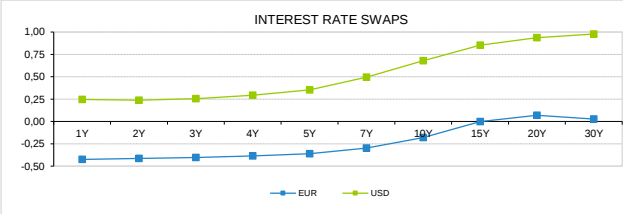


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4248	0	-7	-0,4049	-0,3326	-0,1839
2Y	-0,4146	1	-4	-0,3922	-0,3051	-0,1400
3Y	-0,4027	1	-3	-0,3730	-0,2656	-0,0940
4Y	-0,3853	1	-3	-0,3457	-0,2230	-0,0494
5Y	-0,3618	1	-3	-0,3131	-0,1764	0,0020
7Y	-0,2980	2	-3	-0,2373	-0,0869	0,0843
10Y	-0,1802	2	-3	-0,1115	0,0382	0,1766
15Y	-0,0023	2	-2	0,0446	0,1341	0,2123
20Y	0,0689	3	-2	0,0908	0,1328	0,1662
30Y	0,0265	3	-1	0,0338	0,0468	0,0537

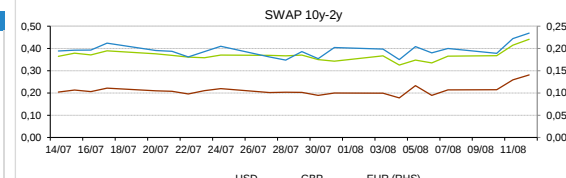
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2461	0	-1	0,2282	0,4118	0,7820
2Y	0,2377	1	1	0,2583	0,5015	0,8470
3Y	0,2548	1	2	0,3085	0,5840	0,9035
4Y	0,2933	1	2	0,3635	0,6787	0,9640
5Y	0,3522	1	2	0,4380	0,7430	1,0179
7Y	0,4954	2	3	0,6082	0,8520	1,0590
10Y	0,6788	3	6	0,7759	0,9570	1,1030
15Y	0,8523	4	8	0,9168	1,0350	1,1300
20Y	0,9361	4	9	0,9690	1,0570	1,1200
30Y	0,9776	4	10	0,9986	1,0433	1,0708

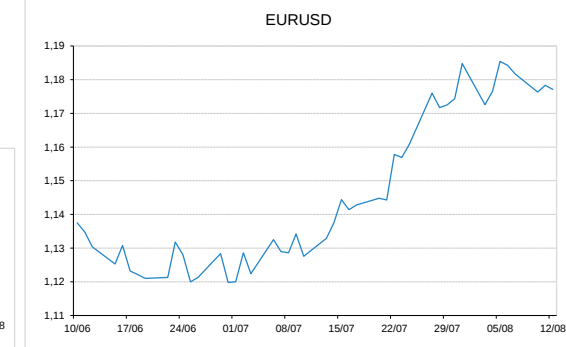
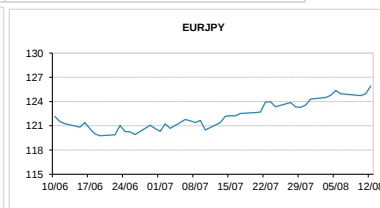
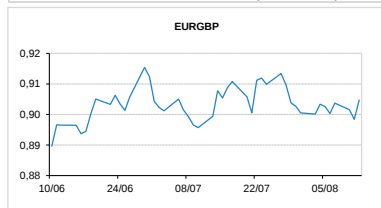


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	45,27	0,77	1,81	OT 2Y	-0,450	0,00	-3,70
JETFUEL	346,85	-1,27	-7,15	OT 5Y	-0,180	0,02	-11,60
DIESEL	375,60	0,47	1,10	OT 10Y	0,324	0,03	-12,70
COBRE	6.405,00	-10,50	-26,00	BUND 10Y	-1,147	3,07	-3,80
ZINCO	2.395,25	11,75	209,00	SCHATZ 2Y	-0,018	1,83	-0,40
OURO	1.942,50	0,44	143,80	T-NOTE 10Y	1,725	1,26	1,00
TRIGO	500,75	-3,00	-38,25	T-NOTE 2Y	0,761	0,00	0,70
LICENÇA C02	25,83	-0,36	-3,19	GILT 10Y	0,269	3,81	5,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1771	-0,10%	3,90%	1,1794	1,1820	1,1865
EUR/GBP	0,90475	-0,70%	-0,59%	0,9061	0,9076	0,9105
EUR/JPY	125,92	-0,75%	-3,59%	125,92	125,92	125,92
EUR/CHF	1,0745	0,31%	-0,51%	1,0738	1,0730	1,0718
EUR/BRL	6,4375	-1,84%	-4,78%	6,4654	6,4937	6,5691
EUR/PLN	4,4031	0,06%	1,94%	4,4092	4,4167	4,4323



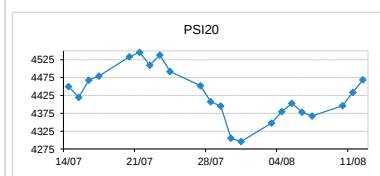
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1771	0,9048	125,92	1,0745	10,2470	7,4465	1,5635	1,64651	6,4375	10,5425
USD	0,8471	-	0,766	106,875	0,9104	8,6779	6,3072	1,3232	1,3944	5,4704	8,9177

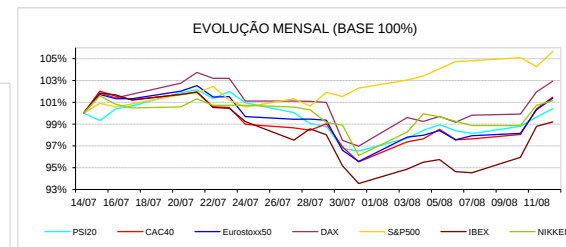
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,466	-0,04	-21,37
BCP	0,107	0,66	-47,29
CORT. AMORIM	10,480	1,16	-7,26
CTT	2,840	1,97	-10,97
EDP	4,396	1,29	16,41
EDP R	13,940	0,00	32,76
GALP	9,780	1,75	-34,36
IBERSOL	5,700	-1,04	-28,75
J MARTINS	14,130	0,82	-3,65
MOTA ENGIL	1,352	1,65	-27,70
NAVIGATOR	2,274	0,53	-34,06
NOS	3,658	-0,22	-23,79
PHAROL	0,117	0,52	17,07
RAMADA	3,550	1,14	-39,21
REN	2,470	1,02	-9,19
SEMAPA	8,060	0,25	-41,25
SONAE CAP.	0,672	0,30	-10,76
SONAE SGPS	0,613	0,91	-32,69

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	1,97
GALP	1,75
MOTA ENGIL	1,65
EDP	1,29
CORT. AMORIM	1,16
ALTRI	-0,04
NOS	-0,22
IBERSOL	-1,04



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.469,09	0,79%	-14,29%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.080,28	1,04%	-15,02%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.367,01	1,05%	-10,10%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.070,61	0,96%	-1,35%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.378,76	1,36%	4,58%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.293,60	0,41%	-23,62%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.843,96	0,41%	-3,44%	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.