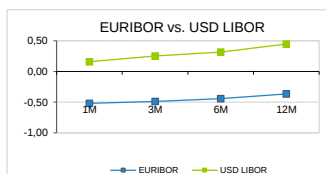


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

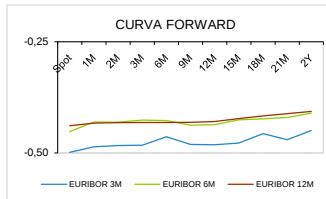
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5190	0	-1	1M	0,1580	0	-2	0,0525
3M	-0,4880	-1	-5	3M	0,2530	-1	-2	0,0748
6M	-0,4420	0	-9	6M	0,3153	0	-2	0,1245
12M	-0,3660	0	-8	12M	0,4471	-1	-2	0,2606

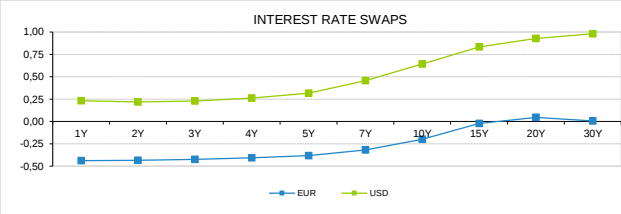


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4385	0	-7	-0,4293	-0,3530	-0,2083
2Y	-0,4342	0	-4	-0,4179	-0,3199	-0,1630
3Y	-0,4250	-1	-3	-0,3970	-0,2825	-0,1170
4Y	-0,4075	-1	-2	-0,3690	-0,2405	-0,0715
5Y	-0,3820	0	-2	-0,3367	-0,1971	-0,0205
7Y	-0,3183	0	-1	-0,2597	-0,1062	0,0625
10Y	-0,2000	0	0	-0,1325	0,0163	0,1525
15Y	-0,0230	0	1	0,0243	0,1132	0,1843
20Y	0,0450	0	1	0,0678	0,1105	0,1403
30Y	0,0050	0	1	0,0096	0,0213	0,0263

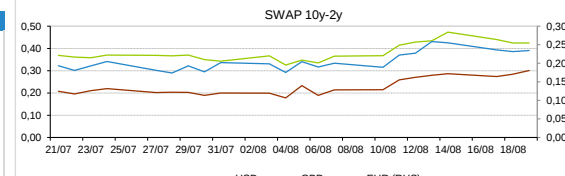
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2310	0	-2	0,2045	0,3659	0,7085
2Y	0,2179	0	0	0,2241	0,4455	0,7905
3Y	0,2275	0	0	0,2707	0,5340	0,8635
4Y	0,2613	0	0	0,3340	0,6055	0,9230
5Y	0,3167	0	0	0,4100	0,6935	0,9803
7Y	0,4555	0	1	0,5663	0,8264	1,0535
10Y	0,6425	0	5	0,7305	0,9473	1,1065
15Y	0,8333	0	9	0,8800	1,0215	1,1255
20Y	0,9276	0	11	0,9754	1,0490	1,1433
30Y	0,9805	0	13	1,0036	1,0375	1,0841

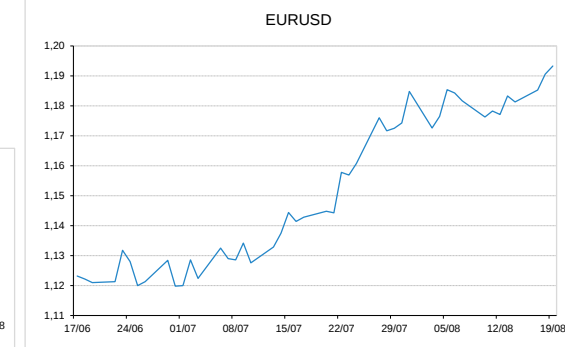
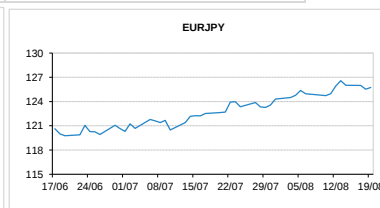
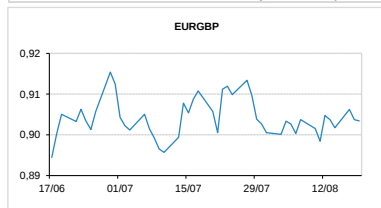


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	45,37	-0,09	2,07	OT 2Y	-0,460	-0,01	-1,30
JETFUEL	350,00	1,59	0,25	OT 5Y	-0,193	-0,02	-4,80
DIESEL	381,50	2,00	10,25	OT 10Y	0,330	-0,01	-3,60
COBRE	6.599,00	121,50	119,50	BUND 10Y	-1,173	-1,07	-1,40
ZINCO	2.447,25	17,00	268,00	SCHATZ 2Y	-0,023	-0,92	0,90
OURO	1.964,39	-42,52	153,97	T-NOTE 10Y	1,968	-0,43	-0,40
TRIGO	521,50	4,00	-19,00	T-NOTE 2Y	2,193	0,00	0,00
LICENÇA C02	26,27	-0,28	-1,55	GILT 10Y	0,265	1,78	8,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1933	0,23%	4,24%	1,1956	1,1982	1,2027
EUR/GBP	0,90345	0,03%	0,25%	0,9048	0,9062	0,9091
EUR/JPY	125,74	-0,16%	-2,47%	125,74	125,74	125,74
EUR/CHF	1,0845	-0,65%	-0,90%	1,0837	1,0829	1,0817
EUR/BRL	6,5427	-0,29%	-6,72%	6,5707	6,5972	6,6651
EUR/PLN	4,4046	-0,60%	1,18%	4,4109	4,4189	4,4357



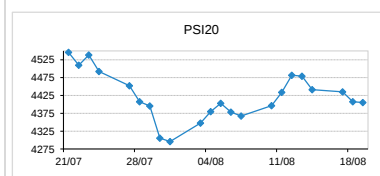
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1933	0,9035	125,74	1,0845	10,3079	7,4458	1,5669	1,64557	6,5427	10,5323
USD	0,8403	-	0,7585	105,645	0,9102	8,6649	6,2562	1,3164	1,3820	5,4950	8,8498

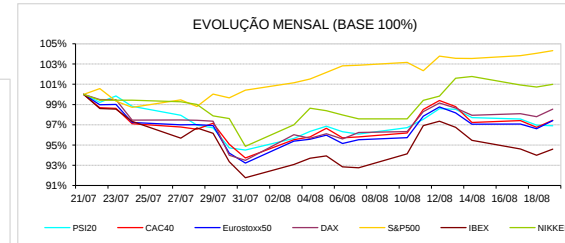
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,408	-0,59	-22,39
BCP	0,105	0,77	-48,22
CORT. AMORIM	10,460	0,00	-7,43
CTT	2,825	-1,05	-11,44
EDP	4,300	-0,60	13,86
EDP R	13,880	0,58	32,19
GALP	9,318	-1,15	-37,46
IBERSOL	5,380	-0,37	-32,75
J MARTINS	13,945	-0,29	-4,91
MOTA ENGIL	1,436	0,00	-23,21
NAVIGATOR	2,316	-0,09	-32,84
NOS	3,588	0,06	-25,25
PHAROL	0,112	-1,75	12,85
RAMADA	3,500	0,86	-40,07
REN	2,465	0,82	-9,38
SEMAPA	7,910	-0,13	-42,35
SONAE CAP.	0,670	-0,59	-11,02
SONAE SGPS	0,605	0,67	-33,52

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
RAMADA	0,86
REN	0,82
BCP	0,77
SONAE SGPS	0,67
EDP R	0,58
SONAE CAP.	-0,59
EDP	-0,60
CTT	-1,05
GALP	-1,15
PHAROL	-1,75



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.405,17	-0,05%	-15,51%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.973,66	0,72%	-16,80%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.317,04	0,83%	-11,43%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.979,62	0,76%	-2,03%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.398,00	0,24%	5,18%	3.398,08	2.191,86
IBEX 35	7.089,50	0,65%	-25,76%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.110,61	0,26%	-2,31%	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.