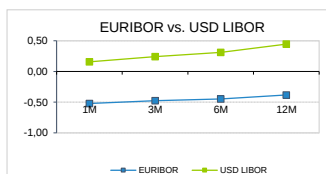


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

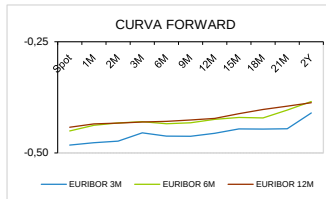
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5220	0	-1	1M	0,1568	0	-1	0,0544
3M	-0,4770	0	-1	3M	0,2409	-1	-3	0,0640
6M	-0,4480	0	-4	6M	0,3099	0	-1	0,1163
12M	-0,3830	-1	-5	12M	0,4453	0	-2	0,2354

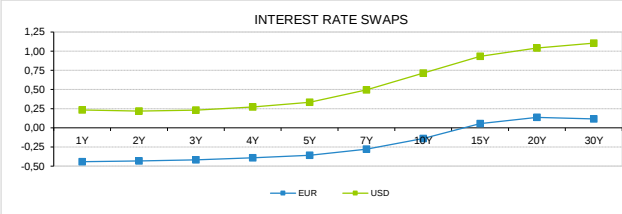


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4420	0	-2	-0,4236	-0,3146	-0,1307
2Y	-0,4320	0	0	-0,4070	-0,2712	-0,0795
3Y	-0,4180	0	1	-0,3766	-0,2258	-0,0295
4Y	-0,3920	0	3	-0,3369	-0,1745	0,0220
5Y	-0,3582	0	4	-0,2955	-0,1250	0,0790
7Y	-0,2780	0	6	-0,2051	-0,0213	0,1656
10Y	-0,1390	0	9	-0,0595	0,1084	0,2580
15Y	0,0550	0	12	0,1095	0,2158	0,2984
20Y	0,1362	-1	14	0,1652	0,2223	0,2618
30Y	0,1168	0	17	0,1262	0,1483	0,1604

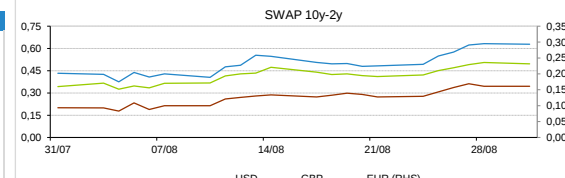
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2329	0	2	0,2041	0,3920	0,8010
2Y	0,2186	0	4	0,2305	0,4805	0,8950
3Y	0,2312	-1	5	0,2780	0,5840	0,9820
4Y	0,2708	-1	7	0,3530	0,6850	1,0531
5Y	0,3329	0	8	0,4471	0,7846	1,1086
7Y	0,4955	-1	13	0,6190	0,9275	1,1869
10Y	0,7148	-1	19	0,8155	1,0430	1,2497
15Y	0,9324	-2	26	0,9925	1,1688	1,2800
20Y	1,0406	-2	30	1,0820	1,2081	1,2730
30Y	1,1050	-2	34	1,1255	1,1919	1,2339

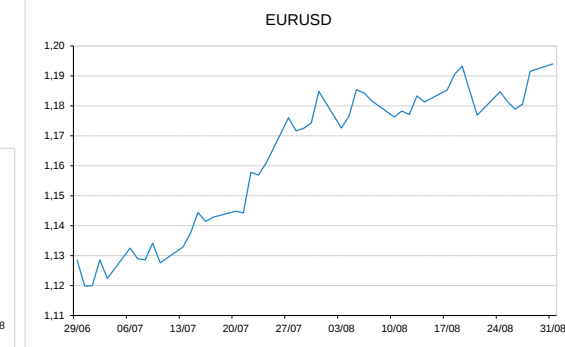
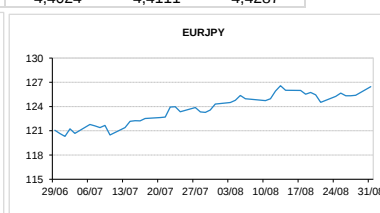


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	45,93	0,12	2,08	OT 2Y	-0,483	0,01	-2,60
JETFUEL	338,00	3,50	-11,00	OT 5Y	-0,142	0,02	5,90
DIESEL	369,25	3,25	-6,25	OT 10Y	0,424	0,03	10,20
COBRE	6.674,00	46,00	190,00	BUND 10Y	-1,101	1,21	14,50
ZINCO	2.498,25	30,50	253,50	SCHATZ 2Y	-0,005	0,92	7,10
OURO	1.969,09	4,26	-6,77	T-NOTE 10Y	1,707	-0,56	6,30
TRIGO	551,50	2,75	12,75	T-NOTE 2Y	0,744	0,37	2,40
LICENÇA C02	28,65	-0,87	2,37	GILT 10Y	0,421	-2,76	22,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,194	0,21%	0,78%	1,1963	1,1990	1,2036
EUR/GBP	0,89605	-0,15%	0,50%	0,8974	0,8988	0,9017
EUR/JPY	126,47	-0,85%	-1,71%	126,47	126,47	126,47
EUR/CHF	1,0771	-0,06%	-0,11%	1,0763	1,0755	1,0742
EUR/BRL	6,5467	-2,02%	-6,07%	6,5739	6,6021	6,6743
EUR/PLN	4,3958	-0,21%	0,43%	4,4024	4,4111	4,4287



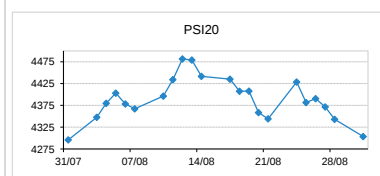
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1940	0,8961	126,47	1,0771	10,3097	7,4436	1,5589	1,6189	6,5467	10,4014
USD	0,8361	-	0,7469	106,02	0,9004	8,6240	6,2236	1,3028	1,3520	5,4882	8,6823

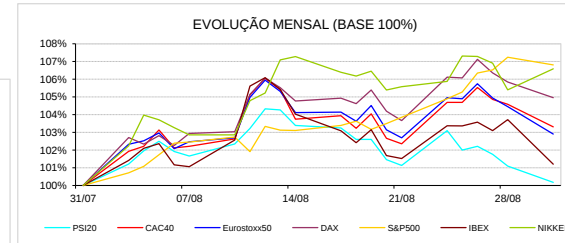
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,188	1,21	-26,27
BCP	0,099	-1,88	-51,18
CORT. AMORIM	10,040	0,60	-11,15
CTT	2,605	-2,98	-18,34
EDP	4,221	-0,94	11,77
EDP R	14,340	-0,14	36,57
GALP	9,000	-1,53	-39,60
IBERSOL	5,400	0,00	-32,50
J MARTINS	13,770	-0,25	-6,10
MOTA ENGL	1,598	-4,31	-14,55
NAVIGATOR	2,210	-0,90	-35,91
NOS	3,382	-2,65	-29,54
PHAROL	0,105	-0,95	5,02
RAMADA	3,500	-4,11	-40,07
REN	2,430	0,62	-10,66
SEMAPA	7,650	-0,52	-44,24
SONAE CAP.	0,688	0,29	-8,63
SONAE SGPS	0,599	-1,16	-34,23

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	1,21
REN	0,62
CORT. AMORIM	0,60
SONAE CAP.	0,29
BCP	-1,88
NOS	-2,65
CTT	-2,98
RAMADA	-4,11
MOTA ENGL	-4,31



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.303,38	-0,91%	-17,47%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.942,18	-1,21%	-17,33%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.266,55	-1,48%	-12,78%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.924,02	-0,84%	-2,45%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.494,61	-0,40%	8,14%	3.510,00	2.191,86
IBEX 35	6.960,20	-2,42%	-27,11%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.139,76	1,12%	-2,18%	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.