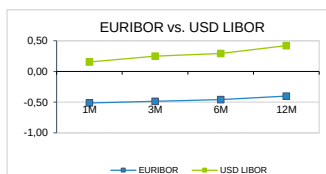


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

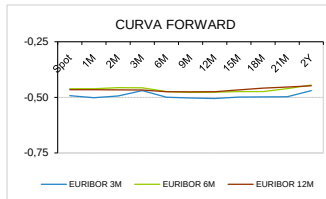
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5130	0	0	1M	0,1543	0	1	0,0540
3M	-0,4870	0	-1	3M	0,2480	0	0	0,0668
6M	-0,4590	-1	-4	6M	0,2921	0	-1	0,1224
12M	-0,4010	0	-5	12M	0,4210	-1	-3	0,2191

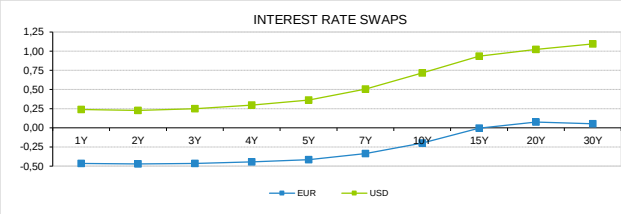


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4651	0	-4	-0,4746	-0,3789	-0,2011
2Y	-0,4710	0	-5	-0,4612	-0,3389	-0,1481
3Y	-0,4642	0	-5	-0,4353	-0,2926	-0,0930
4Y	-0,4439	-1	-4	-0,4012	-0,2434	-0,0400
5Y	-0,4148	-1	-3	-0,3611	-0,1910	0,0142
7Y	-0,3368	-1	-1	-0,2688	-0,0840	0,1030
10Y	-0,1981	-1	2	-0,1212	0,0493	0,2001
15Y	-0,0047	0	5	0,0480	0,1521	0,2403
20Y	0,0753	0	6	0,1035	0,1595	0,1997
30Y	0,0528	0	9	0,0617	0,0830	0,0962

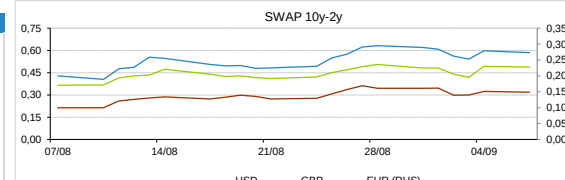
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2387	0	2	0,2188	0,4401	0,7895
2Y	0,2270	0	2	0,2571	0,5356	0,9621
3Y	0,2497	0	3	0,3068	0,6331	1,0061
4Y	0,2966	0	5	0,3772	0,7246	1,0673
5Y	0,3628	0	7	0,4813	0,8045	1,0805
7Y	0,5051	-1	9	0,6455	0,9400	1,1726
10Y	0,7149	-1	14	0,8382	1,0599	1,2403
15Y	0,9341	0	20	1,0110	1,1527	1,2929
20Y	1,0233	-2	21	1,0927	1,1988	1,2822
30Y	1,0950	0	24	1,1231	1,1798	1,2162

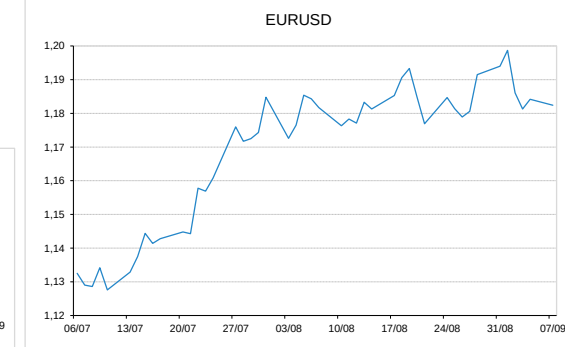
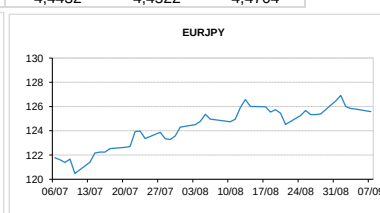


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	41,98	-0,68	-2,79	OT 2Y	-0,541	0,00	-8,80
JETFUEL	317,89	-4,78	-37,19	OT 5Y	-0,172	0,01	2,70
DIESEL	342,14	-6,28	-35,94	OT 10Y	0,380	0,01	7,60
COBRE	6.780,00	146,50	257,00	BUND 10Y	-0,978	1,70	7,10
ZINCO	2.459,00	-30,25	123,50	SCHATZ 2Y	-0,135	0,69	0,00
OURO	1.930,02	-3,93	-105,53	T-NOTE 10Y	1,728	-0,42	8,90
TRIGO	550,25	-3,00	33,75	T-NOTE 2Y	0,728	-1,11	3,30
LICENÇA C02	27,05	-0,31	0,63	GILT 10Y	0,357	-0,17	14,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1824	-0,15%	0,06%	1,1848	1,1875	1,1924
EUR/GBP	0,89835	-0,57%	0,60%	0,8997	0,9011	0,9042
EUR/JPY	125,59	0,16%	-0,54%	125,59	125,59	125,59
EUR/CHF	1,0822	-0,07%	-0,61%	1,0815	1,0806	1,0794
EUR/BRL	6,277	-0,07%	-0,50%	6,3041	6,3007	6,4024
EUR/PLN	4,4361	0,46%	-0,58%	4,4432	4,4522	4,4704



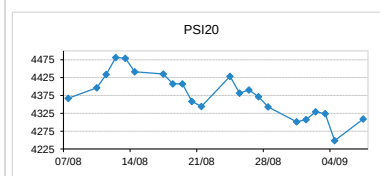
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1824	0,8984	125,59	1,0822	10,3657	7,4407	1,5464	1,62381	6,2770	10,5650
USD	0,8456	-	0,7589	106,275	0,9148	8,7542	6,2916	1,3081	1,3734	5,3022	8,9150

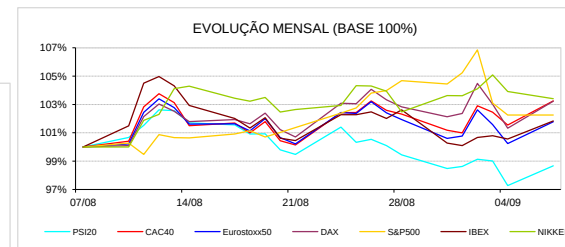
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,456	1,55	-21,55
BCP	0,095	0,00	-53,40
CORT. AMORIM	10,080	0,80	-10,80
CTT	2,565	-0,97	-19,59
EDP	4,259	2,97	12,78
EDP R	14,040	2,33	33,71
GALP	9,108	2,50	-38,87
IBERSOL	5,320	-0,75	-33,50
J MARTINS	13,870	0,84	-5,42
MOTA ENGIL	1,466	-0,14	-21,60
NAVIGATOR	2,320	1,22	-32,72
NOS	3,408	1,73	-29,00
PHAROL	0,110	0,91	10,84
RAMADA	3,330	-1,77	-42,98
REN	2,415	1,05	-11,21
SEMAPA	8,050	0,00	-41,33
SONAE CAP.	0,690	0,29	-8,37
SONAE SGPS	0,606	0,17	-33,46

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP	2,97
GALP	2,50
EDP R	2,33
NOS	1,73
ALTRI	1,55
MOTA ENGIL	-0,14
IBERSOL	-0,75
CTT	-0,97
RAMADA	-1,77



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.308,95	1,43%	-17,36%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.048,75	1,69%	-15,55%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.310,64	1,53%	-11,60%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.083,60	1,88%	-1,25%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.426,96	-0,81%	6,07%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	7.077,90	1,26%	-25,88%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.089,95	-0,50%	-2,40%	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.