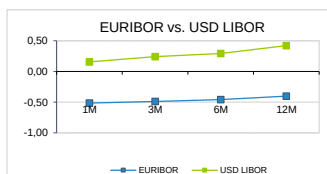


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

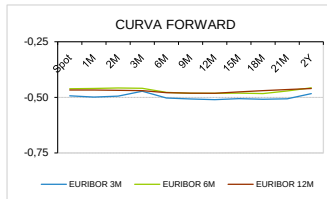
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5150	0	-1	1M	0,1556	0	-1	0,0540
3M	-0,4880	0	-1	3M	0,2418	-1	-1	0,0653
6M	-0,4590	0	-4	6M	0,2933	0	-2	0,1173
12M	-0,4020	0	-5	12M	0,4210	0	-3	0,2153

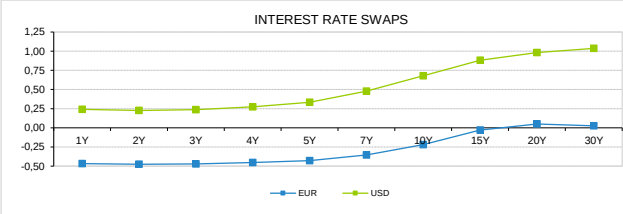


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4671	0	-4	-0,4850	-0,4009	-0,2295
2Y	-0,4753	0	-4	-0,4730	-0,3646	-0,1770
3Y	-0,4707	-1	-4	-0,4477	-0,3188	-0,1242
4Y	-0,4525	-1	-3	-0,4187	-0,2701	-0,0708
5Y	-0,4277	-2	-3	-0,3801	-0,2197	-0,0180
7Y	-0,3550	-2	-1	-0,2914	-0,1153	0,0730
10Y	-0,2200	-2	3	-0,1468	0,0165	0,1665
15Y	-0,0280	-2	5	0,0219	0,1235	0,2057
20Y	0,0500	-2	6	0,0758	0,1293	0,1682
30Y	0,0260	-3	9	0,0329	0,0521	0,0643

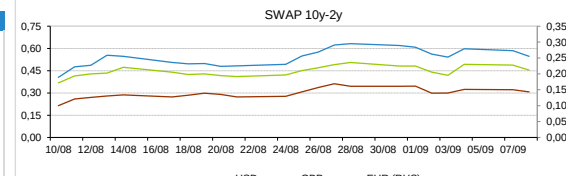
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2405	0	0	0,2090	0,3680	0,7633
2Y	0,2262	0	1	0,2305	0,4775	0,9227
3Y	0,2374	-1	2	0,2850	0,5530	0,8915
4Y	0,2745	-2	3	0,3445	0,6089	0,9760
5Y	0,3329	-3	4	0,4264	0,7270	1,0382
7Y	0,4795	-3	6	0,5805	0,8430	1,1126
10Y	0,6798	-4	10	0,7831	0,9645	1,1717
15Y	0,8811	-5	14	0,9210	1,1699	1,2704
20Y	0,9825	-4	16	1,0955	1,1335	1,2134
30Y	1,0364	-6	17	1,0593	1,1115	1,1463

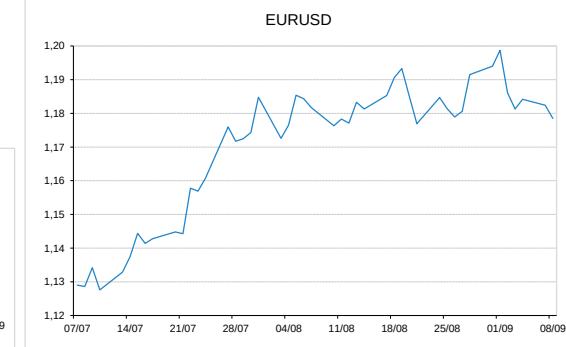
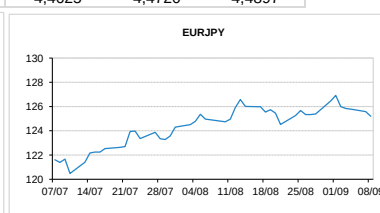


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	39,53	-2,48	-5,24	OT 2Y	-0,551	-0,01	-10,40
JETFUEL	311,57	-6,32	-33,94	OT 5Y	-0,181	-0,01	2,30
DIESEL	337,29	-4,85	-34,47	OT 10Y	0,358	-0,02	6,10
COBRE	6.792,00	79,00	481,00	BUND 10Y	-1,012	-3,26	0,80
ZINCO	2.482,00	23,00	83,75	SCHATZ 2Y	-0,142	-0,69	-1,80
OURO	1.926,68	-1,92	-108,87	T-NOTE 10Y	1,696	-3,65	3,90
TRIGO	544,75	-5,50	41,25	T-NOTE 2Y	0,722	-1,66	1,50
LICENÇA C02	26,98	-0,07	0,56	GILT 10Y	0,293	-6,06	3,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1785	-0,33%	0,19%	1,1809	1,1838	1,1886
EUR/GBP	0,90453	-0,68%	-0,33%	0,9059	0,9073	0,9102
EUR/JPY	125,2	0,31%	-0,37%	125,20	125,20	125,20
EUR/CHF	1,0804	0,25%	-0,49%	1,0797	1,0788	1,0776
EUR/BRL	6,3083	-0,49%	1,97%	6,3255	6,3541	6,4285
EUR/PLN	4,4555	-0,41%	-1,30%	4,4625	4,4720	4,4897



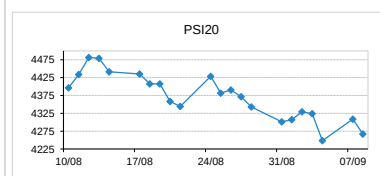
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1785	0,9045	125,20	1,0804	10,3898	7,4412	1,5559	1,63033	6,3083	10,7175
USD	0,8479	-	0,7676	105,94	0,9171	8,8094	6,3092	1,3194	1,3822	5,3598	9,0842

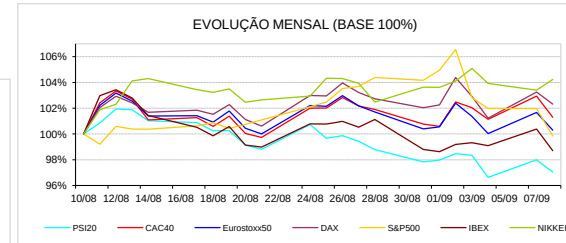
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,584	2,92	-19,30
BCP	0,094	-0,42	-53,60
CORT. AMORIM	9,950	-0,70	-11,95
CTT	2,635	2,93	-17,40
EDP	4,187	-1,76	10,87
EDP R	13,580	-3,41	29,33
GALP	8,854	-2,77	-40,58
IBERSOL	5,380	1,13	-32,75
J MARTINS	13,875	0,00	-5,39
MOTA ENGL	1,412	-3,68	-24,49
NAVIGATOR	2,336	0,26	-32,26
NOS	3,396	-0,29	-29,25
PHAROL	0,114	3,25	14,86
RAMADA	3,310	-0,60	-43,32
REN	2,395	-0,62	-11,95
SEMAPA	8,020	-0,37	-41,55
SONAE CAP.	0,694	0,58	-7,84
SONAE SGPS	0,604	-0,08	-33,63

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	3,25
CTT	2,93
ALTRI	2,92
IBERSOL	1,13
SONAE CAP.	0,58
CORT. AMORIM	-0,70
EDP	-1,76
GALP	-2,77
EDP R	-3,41
MOTA ENGL	-3,68



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.266,81	-0,97%	-18,17%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.972,74	-1,60%	-16,82%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.269,44	-1,35%	-12,70%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.981,73	-0,90%	-2,02%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.355,68	-2,10%	3,85%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.962,20	-1,67%	-27,09%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.274,13	0,80%	-1,62%	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.