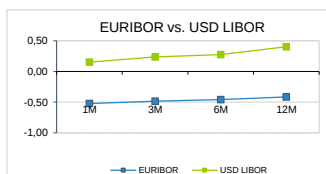


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

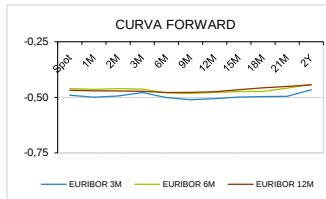
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5230	0	0	1M	0,1521	0	0	0,0493
3M	-0,4850	0	0	3M	0,2373	-1	-3	0,0596
6M	-0,4580	0	-3	6M	0,2745	-1	-6	0,0801
12M	-0,4150	-1	-6	12M	0,4026	-1	-6	0,1603

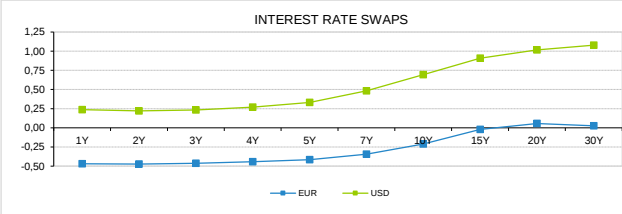


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4682	0	-4	-0,4765	-0,3821	-0,2171
2Y	-0,4730	0	-5	-0,4602	-0,3456	-0,1678
3Y	-0,4630	0	-6	-0,4339	-0,3026	-0,1156
4Y	-0,4430	0	-5	-0,4026	-0,2560	-0,0655
5Y	-0,4155	0	-5	-0,3653	-0,2073	-0,0101
7Y	-0,3443	0	-4	-0,2790	-0,1062	0,0780
10Y	-0,2115	0	-3	-0,1388	0,0243	0,1712
15Y	-0,0214	0	-2	0,0280	0,1278	0,2096
20Y	0,0562	0	-1	0,0811	0,1322	0,1690
30Y	0,0255	0	0	0,0321	0,0484	0,0566

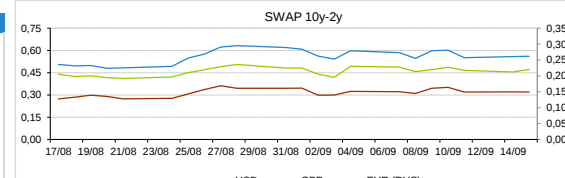
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2368	1	0	0,2025	0,3730	0,7803
2Y	0,2212	1	-1	0,2310	0,4782	0,8410
3Y	0,2329	1	-1	0,2808	0,5625	0,9315
4Y	0,2706	1	-1	0,3523	0,6630	1,0119
5Y	0,3305	1	0	0,4310	0,7562	1,0683
7Y	0,4823	2	0	0,6035	0,8962	1,1516
10Y	0,6928	2	2	0,7993	1,0330	1,2183
15Y	0,9089	3	5	0,9856	1,1433	1,2701
20Y	1,0171	3	6	1,0688	1,1809	1,2663
30Y	1,0785	3	7	1,0820	1,1470	1,1875

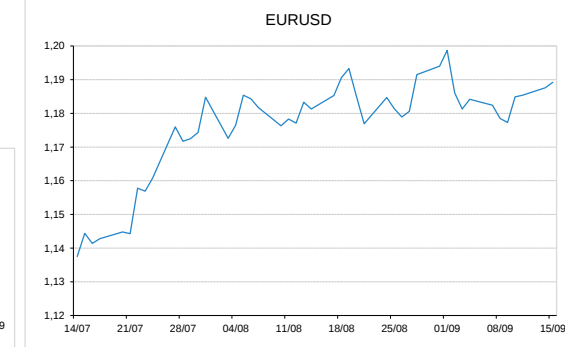
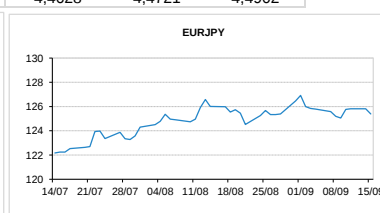


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	40,38	0,77	-4,95	OT 2Y	-0,561	0,01	-12,30
JETFUEL	303,25	-1,75	-48,23	OT 5Y	-0,225	0,00	-6,80
DIESEL	322,75	-2,25	-55,66	OT 10Y	0,297	-0,01	-7,50
COBRE	6.779,50	57,00	429,50	BUND 10Y	-1,000	-0,07	-7,30
ZINCO	2.465,25	7,75	102,25	SCHATZ 2Y	-0,128	0,69	-3,00
OURO	1.952,15	-4,23	7,03	T-NOTE 10Y	1,696	1,26	-3,90
TRIGO	535,50	-10,25	26,00	T-NOTE 2Y	0,728	0,55	-0,70
LICENÇA C02	30,29	-0,18	4,81	GILT 10Y	0,324	2,22	-3,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1892	0,13%	0,33%	1,1915	1,1943	1,1992
EUR/GBP	0,92095	0,10%	-1,60%	0,9223	0,9237	0,9267
EUR/JPY	125,39	0,34%	0,48%	125,39	125,39	125,39
EUR/CHF	1,0763	0,07%	-0,11%	1,0755	1,0747	1,0735
EUR/BRL	6,2591	-0,07%	4,52%	6,2844	6,3128	6,3898
EUR/PLN	4,4560	-0,22%	-1,27%	4,4628	4,4721	4,4902



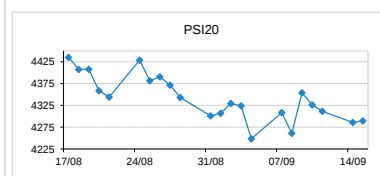
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1892	0,9210	125,39	1,0763	10,4153	7,4396	1,5632	1,62431	6,2591	10,7089
USD	0,8437	-	0,7778	105,475	0,9079	8,7865	6,2773	1,3176	1,3694	5,2841	9,0427

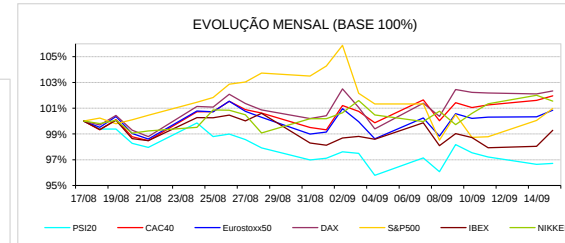
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,156	-0,57	-26,83
BCP	0,092	-0,65	-54,83
CORT. AMORIM	10,560	-0,94	-6,55
CTT	2,560	-0,39	-19,75
EDP	4,248	0,57	12,49
EDP R	14,220	1,14	35,43
GALP	8,988	1,63	-39,68
IBERSOL	5,400	0,75	-32,50
J MARTINS	13,980	0,32	-4,67
MOTA ENGIL	1,278	-1,39	-31,66
NAVIGATOR	2,324	-0,09	-32,61
NOS	3,372	-2,15	-29,75
PHAROL	0,113	2,91	13,45
RAMADA	3,280	0,31	-43,84
REN	2,400	0,42	-11,76
SEMAPA	7,910	-0,63	-42,35
SONAE CAP.	0,700	0,00	-7,04
SONAE SGPS	0,610	-0,89	-33,02

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
PHAROL	2,91
GALP	1,63
EDP R	1,14
IBERSOL	0,75
EDP	0,57
BCP	-0,65
SONAE SGPS	-0,89
CORT. AMORIM	-0,94
MOTA ENGIL	-1,39
NOS	-2,15



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.289,65	0,09%	-17,73%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.069,32	0,35%	-15,20%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.333,62	0,51%	-10,99%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.222,45	0,22%	-0,20%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.415,91	0,93%	5,71%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	7.039,60	1,27%	-26,28%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.454,89	-0,44%	-0,85%	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.