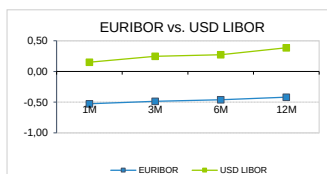


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

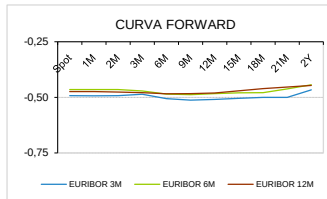
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5260	0	-1	1M	0,1505	0	0	0,0490
3M	-0,4870	0	-1	3M	0,2461	1	-2	0,0591
6M	-0,4620	0	-3	6M	0,2733	0	-6	0,0840
12M	-0,4190	0	-7	12M	0,3858	-2	-8	0,1669

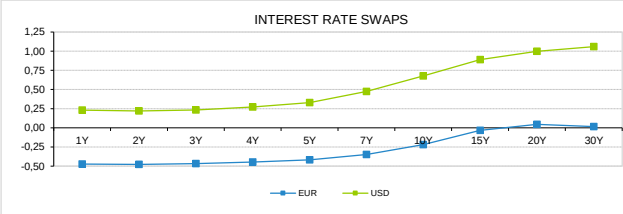


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4739	-1	-4	-0,4812	-0,3860	-0,2328
2Y	-0,4775	-1	-6	-0,4634	-0,3485	-0,1787
3Y	-0,4679	-1	-6	-0,4375	-0,3084	-0,1268
4Y	-0,4461	0	-5	-0,4055	-0,2625	-0,0768
5Y	-0,4182	0	-5	-0,3703	-0,2143	-0,0249
7Y	-0,3480	0	-4	-0,2849	-0,1161	0,0630
10Y	-0,2190	-1	-3	-0,1475	0,0120	0,1549
15Y	-0,0322	-1	-3	0,0186	0,1180	0,1968
20Y	0,0452	-1	-2	0,0715	0,1221	0,1577
30Y	0,0170	-1	-1	0,0233	0,0385	0,0464

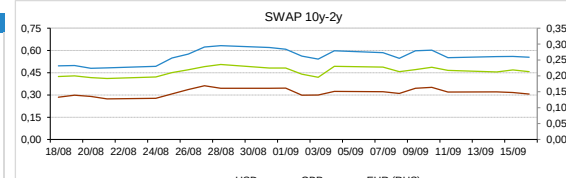
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2299	-1	-1	0,2124	0,3560	0,7455
2Y	0,2201	0	-1	0,2285	0,4755	0,8397
3Y	0,2332	0	-1	0,2810	0,5560	0,9030
4Y	0,2710	0	-1	0,3566	0,6568	0,9806
5Y	0,3295	0	-1	0,4358	0,7300	1,0375
7Y	0,4740	-1	0	0,5935	0,8722	1,1211
10Y	0,6774	-1	1	0,7851	0,9970	1,1720
15Y	0,8902	-2	3	0,9653	1,1182	1,2240
20Y	0,9980	-2	4	1,0496	1,1564	1,2410
30Y	1,0590	-2	5	1,0860	1,1360	1,1740

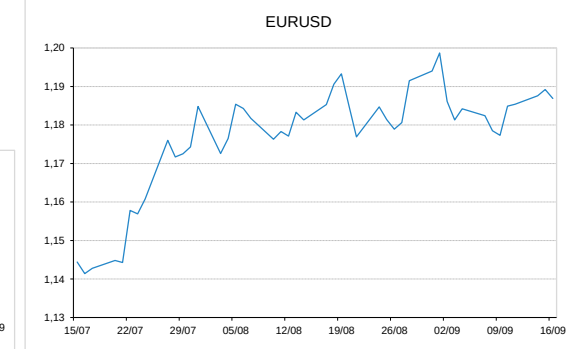
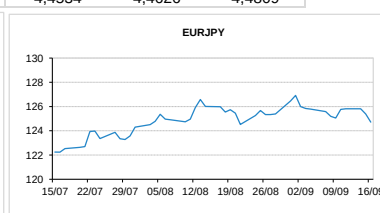


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	41,95	1,42	-3,38	OT 2Y	-0,572	-0,01	-12,10
JETFUEL	304,25	1,00	-47,23	OT 5Y	-0,238	-0,01	-6,40
DIESEL	323,50	0,75	-54,91	OT 10Y	0,287	-0,01	-6,00
COBRE	6.758,00	-34,50	395,00	BUND 10Y	-1,001	-0,14	-4,40
ZINCO	2.482,25	17,00	119,25	SCHATZ 2Y	-0,121	0,69	-1,30
OURO	1.967,99	9,88	22,87	T-NOTE 10Y	1,686	-0,42	-3,00
TRIGO	538,75	0,50	29,25	T-NOTE 2Y	0,728	0,18	-1,10
LICENÇA C02	30,04	0,25	4,56	GILT 10Y	0,315	-0,60	-1,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1869	-0,19%	0,14%	1,1892	1,1919	1,1968
EUR/GBP	0,91423	0,74%	-0,87%	0,9156	0,9170	0,9200
EUR/JPY	124,72	0,54%	1,02%	124,72	124,72	124,72
EUR/CHF	1,0749	0,15%	0,02%	1,0741	1,0733	1,0721
EUR/BRL	6,2002	0,82%	5,52%	6,2265	6,2554	6,3439
EUR/PLN	4,4468	0,20%	-1,07%	4,4534	4,4626	4,4809



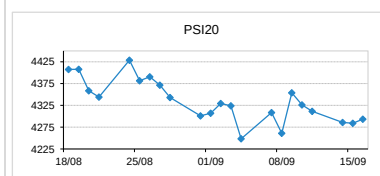
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1869	0,9142	124,72	1,0749	10,4019	7,4393	1,5584	1,61346	6,2002	10,6672
USD	0,8456	-	0,7692	104,835	0,9082	8,7869	6,2901	1,3176	1,3641	5,2488	9,0188

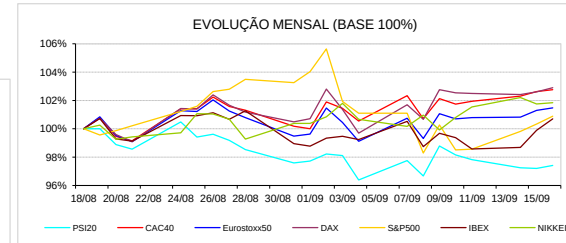
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,176	0,63	-26,48
BCP	0,091	-0,22	-55,08
CORT. AMORIM	10,540	0,19	-6,73
CTT	2,545	-0,78	-20,22
EDP	4,254	0,35	12,65
EDP R	14,100	-0,70	34,29
GALP	9,098	1,29	-38,94
IBERSOL	5,400	-0,74	-32,50
J MARTINS	14,000	0,11	-4,53
MOTA ENGIL	1,260	-1,41	-32,62
NAVIGATOR	2,378	2,59	-31,04
NOS	3,324	-1,07	-30,75
PHAROL	0,117	3,54	17,47
RAMADA	3,230	-1,52	-44,69
REN	2,420	0,83	-11,03
SEMAPA	8,040	1,39	-41,40
SONAE CAP.	0,702	0,29	-6,77
SONAE SGPS	0,608	-0,33	-33,24

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	3,54
NAVIGATOR	2,59
SEMAPA	1,39
GALP	1,29
REN	0,83
IBERSOL	-0,74
CTT	-0,78
NOS	-1,07
MOTA ENGIL	-1,41
RAMADA	-1,52



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.293,62	0,22%	-17,65%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.074,42	0,13%	-15,12%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.338,13	0,18%	-10,87%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.255,37	0,29%	0,05%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.419,46	0,55%	5,86%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	7.093,00	0,81%	-25,72%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.475,53	0,09%	-0,77%	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.