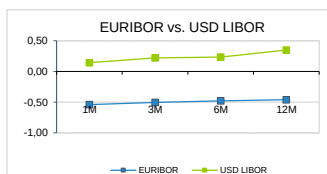


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

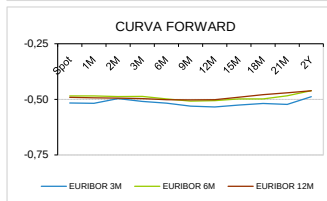
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATE								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5400	-1	-2	1M	0,1428	0	-1	0,0458
3M	-0,5050	0	-2	3M	0,2203	-1	-3	0,0488
6M	-0,4790	1	-3	6M	0,2338	-1	-6	0,0776
12M	-0,4600	0	-6	12M	0,3488	-1	-7	0,1521

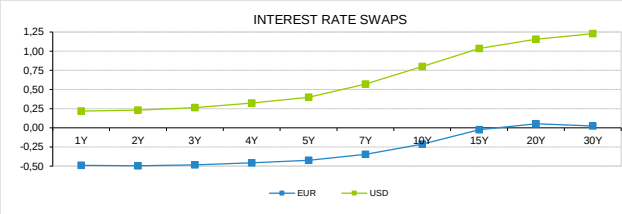


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4900	-1	-2	-0,5012	-0,3790	-0,2109
2Y	-0,4953	0	-2	-0,4815	-0,3340	-0,1605
3Y	-0,4837	0	-2	-0,4467	-0,2924	-0,1095
4Y	-0,4570	0	-2	-0,4080	-0,2470	-0,0593
5Y	-0,4233	1	-1	-0,3682	-0,1990	-0,0083
7Y	-0,3463	1	-1	-0,2791	-0,0998	0,0791
10Y	-0,2130	1	-2	-0,1391	0,0266	0,1700
15Y	-0,0252	1	-2	0,0264	0,1286	0,2075
20Y	0,0530	1	-2	0,0798	0,1335	0,1691
30Y	0,0250	1	-3	0,0325	0,0517	0,0615

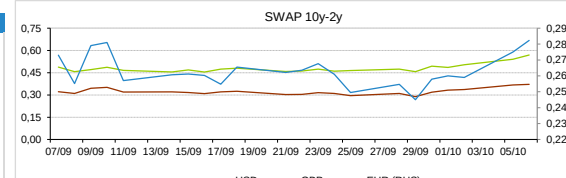
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2187	0	-2	0,2419	0,4992	0,9030
2Y	0,2316	1	0	0,2887	0,5950	0,9950
3Y	0,2646	1	1	0,3563	0,7074	1,0820
4Y	0,3226	1	3	0,4453	0,7940	1,1520
5Y	0,3993	2	4	0,5362	0,8860	1,2188
7Y	0,5704	2	7	0,7170	1,0250	1,2890
10Y	0,8007	3	9	0,9160	1,1690	1,3580
15Y	1,0358	4	10	1,1265	1,2840	1,4140
20Y	1,1551	4	13	1,2175	1,3270	1,4150
30Y	1,2286	5	13	1,2540	1,3270	1,3710

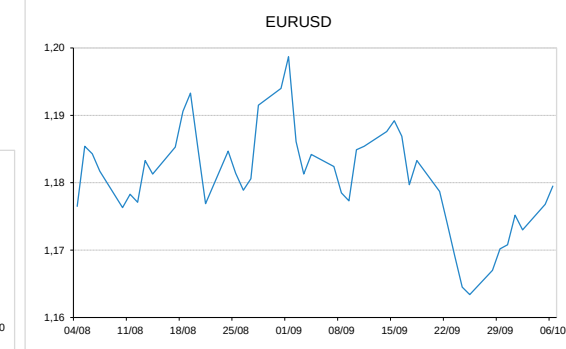
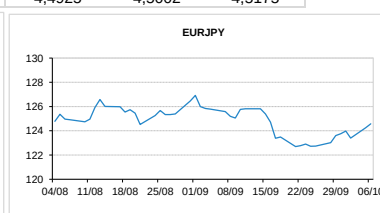


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	42,58	1,29	-0,60	OT 2Y	-0,574	-0,01	-3,60
JETFUEL	330,25	19,99	12,36	OT 5Y	-0,262	-0,03	-8,20
DIESEL	333,75	16,95	-8,39	OT 10Y	0,233	-0,01	-14,00
COBRE	6.525,50	-24,50	-181,50	BUND 10Y	-1,017	1,08	-2,20
ZINCO	2.308,50	-1,25	-161,00	SCHATZ 2Y	-0,126	0,69	1,60
OURO	1.908,60	-7,81	-25,34	T-NOTE 10Y	1,752	0,98	2,00
TRIGO	595,50	11,25	45,25	T-NOTE 2Y	0,735	-0,37	-0,40
LICENÇA C02	26,70	-0,24	-0,66	GILT 10Y	0,396	0,60	3,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1795	0,23%	-0,25%	1,1820	1,1842	1,1890
EUR/GBP	0,91058	-0,27%	-1,34%	0,9120	0,9134	0,9162
EUR/JPY	124,58	-0,26%	0,81%	124,58	124,58	124,58
EUR/CHF	1,0778	0,13%	0,47%	1,0771	1,0764	1,0750
EUR/BRL	6,5214	0,79%	-3,73%	6,5533	6,5905	6,6987
EUR/PLN	4,4841	0,12%	-1,05%	4,4925	4,5002	4,5175



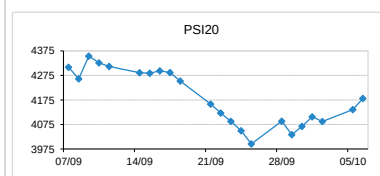
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1795	0,9106	124,58	1,0778	10,5055	7,4408	1,5644	1,64736	6,5214	10,9281
USD	0,8482	-	0,7709	105,625	0,9143	8,9194	6,3110	1,3264	1,3966	5,4910	9,2616

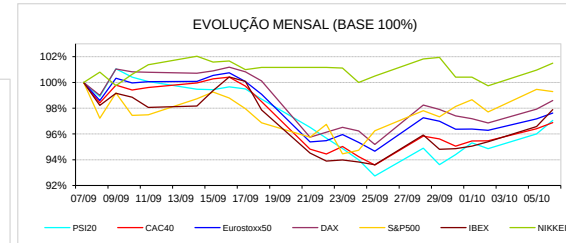
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,896	1,09	-31,41
BCP	0,081	2,28	-60,21
CORT. AMORIM	11,000	3,97	-2,65
CTT	2,560	1,19	-19,75
EDP	4,203	-0,92	11,29
EDP R	14,900	1,22	41,90
GALP	8,434	2,40	-43,40
IBERSOL	4,550	-1,52	-43,13
J MARTINS	14,530	1,89	-0,92
MOTA ENGIL	1,138	1,43	-39,14
NAVIGATOR	2,126	0,28	-38,35
NOS	3,140	1,16	-34,58
PHAROL	0,105	0,19	5,02
RAMADA	3,000	-5,06	-48,63
REN	2,395	0,63	-11,95
SEMAPA	7,500	0,00	-45,34
SONAE CAP.	0,692	-0,86	-8,10
SONAE SGPS	0,580	0,69	-36,26

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	3,97
GALP	2,40
BCP	2,28
J MARTINS	1,89
MOTA ENGIL	1,43
SONAE CAP.	-0,86
EDP	-0,92
IBERSOL	-1,52
RAMADA	-5,06



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.181,28	1,10%	-19,81%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.896,31	0,50%	-18,10%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.235,10	0,46%	-13,62%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.916,09	0,68%	-2,51%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.402,97	-0,17%	5,32%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.931,70	1,37%	-27,41%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.433,73	0,52%	-0,94%	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.