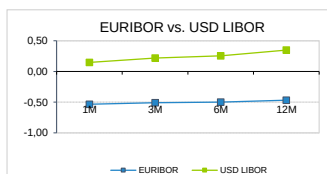


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

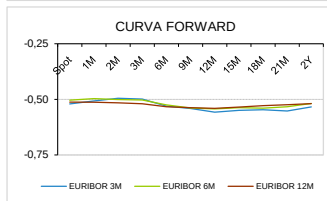
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5340	1	-1	1M	0,1473	0	0	0,0476
3M	-0,5090	0	-2	3M	0,2178	-1	-3	0,0458
6M	-0,4980	0	-4	6M	0,2533	0	-2	0,0773
12M	-0,4680	0	-5	12M	0,3478	0	-4	0,1298
								-0,6038

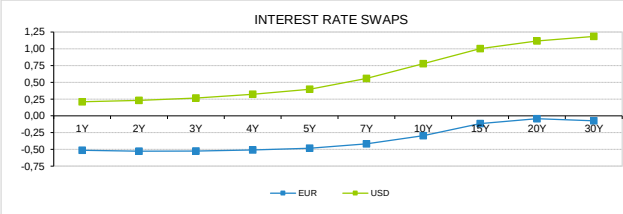


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5126	0	-4	-0,5405	-0,4600	-0,3060
2Y	-0,5270	-1	-5	-0,5299	-0,4250	-0,2572
3Y	-0,5243	-1	-6	-0,5070	-0,3834	-0,2106
4Y	-0,5078	-1	-7	-0,4775	-0,3400	-0,1619
5Y	-0,4840	-1	-7	-0,4423	-0,2947	-0,1118
7Y	-0,4180	0	-7	-0,3616	-0,1996	-0,0267
10Y	-0,2948	0	-8	-0,2285	-0,0765	0,0625
15Y	-0,1153	0	-9	-0,0698	0,0239	0,0998
20Y	-0,0426	0	-9	-0,0201	0,0272	0,0603
30Y	-0,0744	0	-10	-0,0686	-0,0542	-0,0479

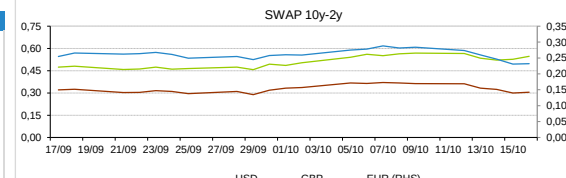
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2102	0	-2	0,2434	0,4908	0,8865
2Y	0,2304	0	1	0,2875	0,5963	0,9185
3Y	0,2654	0	3	0,3571	0,6912	1,0456
4Y	0,3218	1	5	0,4425	0,7425	1,1139
5Y	0,3970	1	7	0,5085	0,8632	1,1730
7Y	0,5578	2	9	0,6974	0,9605	1,2075
10Y	0,7772	2	10	0,8988	1,0960	1,2745
15Y	1,0020	2	12	1,0485	1,2543	1,3823
20Y	1,1165	2	12	1,1395	1,2525	1,3817
30Y	1,1840	3	13	1,2172	1,2796	1,3265

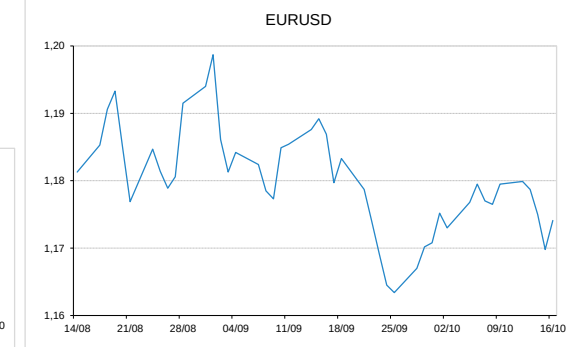
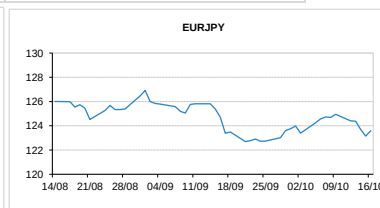
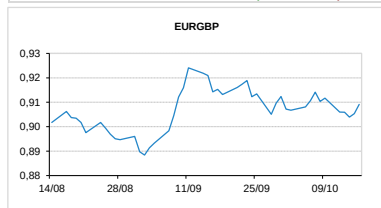


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	42,99	-0,17	0,20	OT 2Y	-0,603	-0,01	-3,10
JETFUEL	345,25	-1,34	41,00	OT 5Y	-0,361	-0,03	-12,50
DIESEL	349,00	0,25	25,50	OT 10Y	0,114	-0,03	-17,40
COBRE	6.779,00	33,00	-12,50	BUND 10Y	-1,137	-0,94	-14,30
ZINCO	2.409,50	8,25	-72,75	SCHATZ 2Y	-0,197	-0,23	-7,80
OURO	1.900,92	-2,80	-64,51	T-NOTE 10Y	1,731	0,70	3,70
TRIGO	626,75	8,50	84,75	T-NOTE 2Y	0,737	0,37	0,90
LICENÇA C02	24,89	-0,07	-5,10	GILT 10Y	0,288	0,51	-3,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1741	0,37%	-1,08%	1,1766	1,1789	1,1838
EUR/GBP	0,90915	-0,42%	0,56%	0,9106	0,9120	0,9149
EUR/JPY	123,59	-0,36%	0,91%	123,59	123,59	123,59
EUR/CHF	1,0723	-0,22%	0,22%	1,0716	1,0709	1,0696
EUR/BRL	6,5912	-0,29%	-6,10%	6,6182	6,6514	6,7599
EUR/PLN	4,5443	0,18%	-2,11%	4,5532	4,5614	4,5781



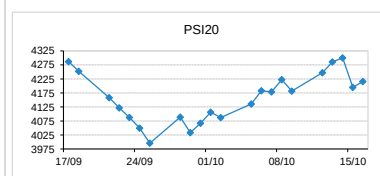
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1741	0,9092	123,59	1,0723	10,3569	7,4417	1,5443	1,6539	6,5912	10,9641
USD	0,8533	-	0,7736	105,385	0,9145	8,8444	6,3496	1,3201	1,4121	5,6356	9,3602

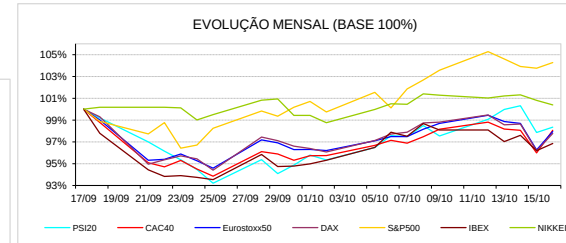
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,726	1,25	-34,40
BCP	0,078	1,44	-61,69
CORT. AMORIM	10,460	0,00	-7,43
CTT	2,480	0,20	-22,26
EDP	4,551	1,34	20,17
EDP R	16,660	-0,95	58,67
GALP	8,172	1,24	-45,15
IBERSOL	4,100	-6,82	-48,75
J MARTINS	14,575	0,73	-0,61
MOTA ENGIL	1,096	0,18	-41,39
NAVIGATOR	2,044	-0,39	-40,73
NOS	3,076	1,18	-35,83
PHAROL	0,100	-1,20	-0,60
RAMADA	3,090	1,64	-47,09
REN	2,405	0,42	-11,21
SEMAPA	7,090	0,00	-48,40
SONAE CAP.	0,700	0,00	-7,04
SONAE SGPS	0,529	0,47	-41,87

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
RAMADA	1,64
BCP	1,44
EDP	1,34
ALTRI	1,25
GALP	1,24
NAVIGATOR	-0,39
EDP R	-0,95
PHAROL	-1,20
IBERSOL	-6,82



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.214,93	0,50%	-19,14%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.937,94	2,16%	-17,34%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.246,82	1,75%	-13,26%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.911,48	1,66%	-2,53%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.500,69	0,50%	8,35%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.863,20	0,68%	-28,13%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.410,63	-0,41%	-1,04%	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.