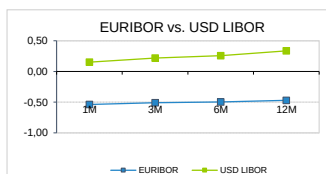


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

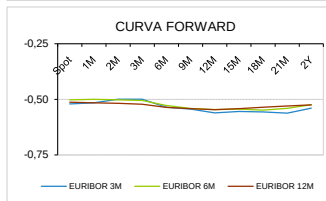
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5380	0	-2	1M	0,1514	0	0	0,0436
3M	-0,5090	0	-1	3M	0,2184	0	-1	0,0459
6M	-0,4970	0	-3	6M	0,2575	0	-1	0,0754
12M	-0,4700	0	-4	12M	0,3350	-1	-4	0,1251

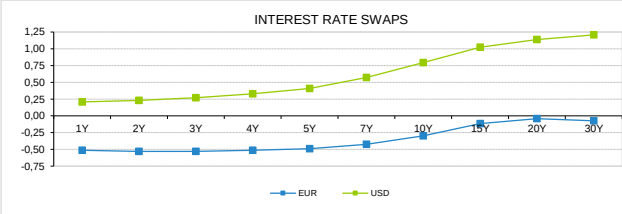


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5139	0	-2	-0,5510	-0,4690	-0,3111
2Y	-0,5305	0	-3	-0,5370	-0,4350	-0,2657
3Y	-0,5290	0	-4	-0,5140	-0,3923	-0,2129
4Y	-0,5137	-1	-5	-0,4850	-0,3487	-0,1624
5Y	-0,4901	-1	-5	-0,4493	-0,3004	-0,1100
7Y	-0,4237	0	-6	-0,3671	-0,2034	-0,0243
10Y	-0,2978	0	-6	-0,2308	-0,0765	0,0655
15Y	-0,1157	1	-6	-0,0702	0,0248	0,1020
20Y	-0,0420	1	-6	-0,0194	0,0290	0,0644
30Y	-0,0731	1	-5	-0,0677	-0,0529	-0,0455

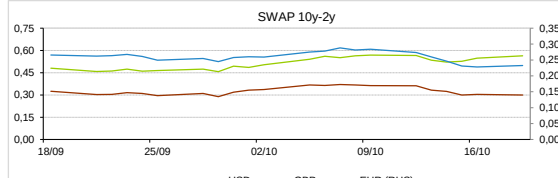
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2075	0	-2	0,2482	0,5080	0,8955
2Y	0,2307	0	1	0,2969	0,6100	0,9780
3Y	0,2690	0	4	0,3650	0,7152	1,0620
4Y	0,3290	0	6	0,4510	0,8071	1,1392
5Y	0,4080	1	8	0,5468	0,8896	1,1985
7Y	0,5727	1	10	0,7110	1,0290	1,2855
10Y	0,7948	2	12	0,9085	1,1683	1,3550
15Y	1,0225	2	13	1,0990	1,2810	1,3880
20Y	1,1384	2	14	1,1998	1,3060	1,3865
30Y	1,2073	3	15	1,2419	1,3043	1,3455

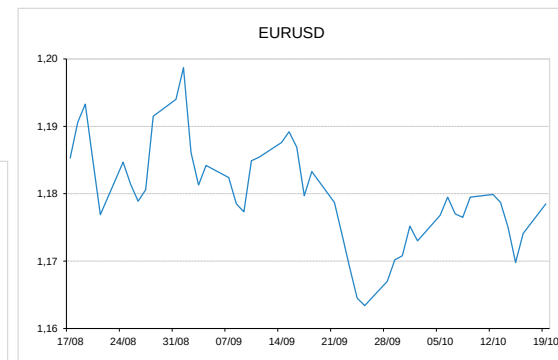
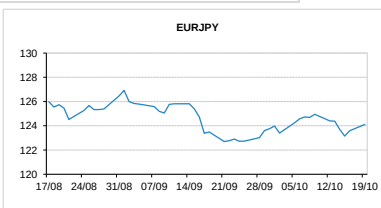
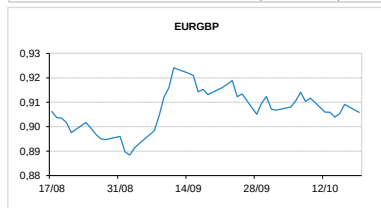


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	42,93	0,00	-0,75	OT 2Y	-0,594	0,01	-1,50
JETFUEL	342,17	-3,08	29,92	OT 5Y	-0,340	0,02	-9,70
DIESEL	346,08	-2,92	17,83	OT 10Y	0,141	0,03	-14,40
COBRE	6,728,00	-9,00	-37,00	BUND 10Y	-1,144	-0,53	-12,70
ZINCO	2,419,50	10,00	-93,60	SCHATZ 2Y	-0,206	-0,91	-7,10
OURO	1,907,49	8,19	-43,37	T-NOTE 10Y	1,746	1,69	5,20
TRIGO	623,00	-2,25	48,00	T-NOTE 2Y	0,743	0,56	2,30
LICENÇA C02	24,86	-0,03	-3,13	GILT 10Y	0,276	-0,85	-0,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1785	0,37%	-0,02%	1,1810	1,1833	1,1882
EUR/GBP	0,90588	0,36%	1,13%	0,9073	0,9087	0,9116
EUR/JPY	124,11	-0,42%	-1,14%	124,11	124,11	124,11
EUR/CHF	1,0719	0,02%	0,34%	1,0712	1,0706	1,0692
EUR/BRL	6,5711	0,69%	-2,99%	6,6099	6,6435	6,7524
EUR/PLN	4,5756	-0,61%	-1,67%	4,5845	4,5927	4,6097



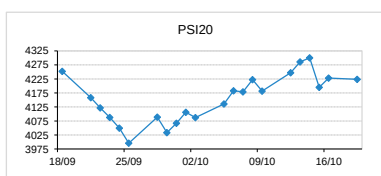
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1785	0,9059	124,11	1,0719	10,3807	7,4414	1,5516	1,66276	6,5711	10,9606
USD	0,8487	-	0,7692	105,465	0,9096	8,7983	6,3156	1,3156	1,4103	5,6011	9,2921

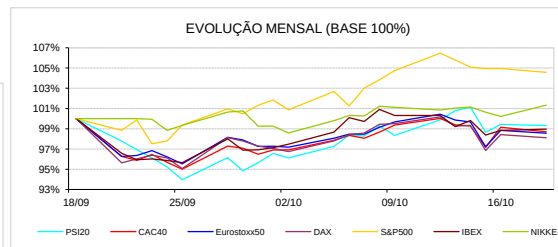
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,800	1,99	-33,10
BCP	0,078	0,39	-61,54
CORT. AMORIM	10,400	-0,57	-7,96
CTT	2,485	0,20	-22,10
EDP	4,484	-1,47	18,74
EDP R	16,720	-1,65	59,24
GALP	8,200	0,34	-44,97
IBERSOL	3,970	-3,17	-50,38
J MARTINS	14,585	0,07	-0,55
MOTA ENGIL	1,106	0,91	-40,86
NAVIGATOR	2,064	0,98	-40,15
NOS	3,130	1,76	-34,79
PHAROL	0,098	-2,40	-2,01
RAMADA	3,030	-1,94	-48,12
REN	2,430	1,04	-10,66
SEMAPA	7,250	2,26	-47,16
SONAE CAP.	0,700	0,00	-7,04
SONAE SGPS	0,526	-0,57	-42,31

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SEMAPA	2,26
ALTRI	1,99
NOS	1,76
REN	1,04
NAVIGATOR	0,98
EDP	-1,47
EDP R	-1,65
RAMADA	-1,94
PHAROL	-2,40
IBERSOL	-3,17



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.223,66	-0,10%	-19,00%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.913,79	-0,45%	-17,80%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.236,23	-0,28%	-13,59%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.868,24	-0,32%	-2,87%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.471,24	-0,36%	7,44%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.858,40	0,13%	-28,18%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.671,13	1,11%	0,06%	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.