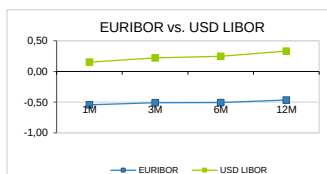


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

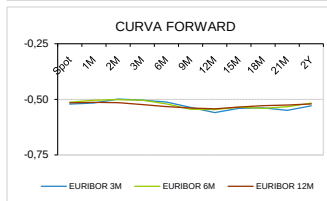
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5430	0	-2	1M	0,1515	0	1	0,0431
3M	-0,5100	0	-1	3M	0,2223	1	0	0,0464
6M	-0,5070	-1	-4	6M	0,2463	0	-3	0,0719
12M	-0,4650	0	-3	12M	0,3320	0	-4	0,1315

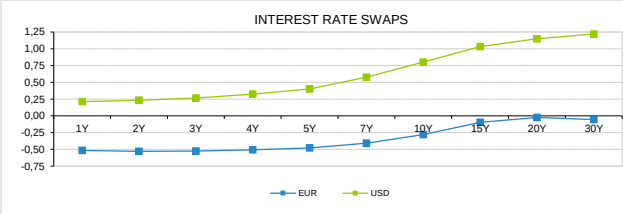


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5157	-1	-3	-0,5426	-0,4484	-0,2841
2Y	-0,5295	-1	-4	-0,5308	-0,4091	-0,2362
3Y	-0,5260	-2	-5	-0,5034	-0,3672	-0,1856
4Y	-0,5065	-2	-5	-0,4699	-0,3225	-0,1348
5Y	-0,4790	-2	-5	-0,4325	-0,2746	-0,0855
7Y	-0,4089	-2	-5	-0,3472	-0,1786	-0,0001
10Y	-0,2805	-3	-5	-0,2115	-0,0533	0,0875
15Y	-0,0969	-3	-4	-0,0506	0,0462	0,1243
20Y	-0,0237	-4	-4	0,0000	0,0494	0,0841
30Y	-0,0555	-4	-4	-0,0503	-0,0350	-0,0291

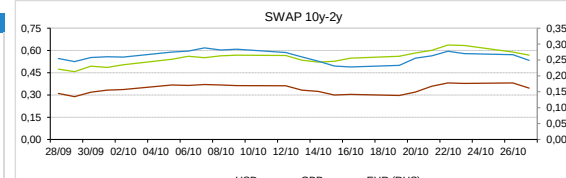
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2115	0	-1	0,2446	0,5027	0,9135
2Y	0,2323	0	1	0,2888	0,6010	1,0020
3Y	0,2656	0	2	0,3591	0,7050	1,0880
4Y	0,3242	-1	4	0,4477	0,8000	1,1582
5Y	0,4020	-1	6	0,5380	0,8967	1,2166
7Y	0,5753	-2	8	0,7198	1,0225	1,3027
10Y	0,8009	-2	10	0,9170	1,1640	1,3737
15Y	1,0336	-3	11	1,1100	1,2958	1,4080
20Y	1,1500	-3	12	1,2126	1,3210	1,4080
30Y	1,2202	-3	13	1,2470	1,3190	1,3667

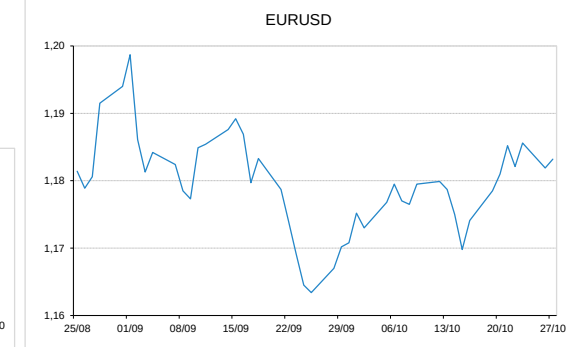
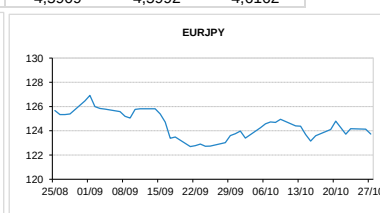


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	41,23	0,77	-1,18	OT 2Y	-0,574	-0,01	0,80
JETFUEL	325,25	-12,25	5,02	OT 5Y	-0,371	-0,03	-15,10
DIESEL	323,50	-10,25	-5,49	OT 10Y	0,132	-0,03	-13,60
COBRE	6.775,00	-86,50	236,00	BUND 10Y	-1,129	-4,22	-8,40
ZINCO	2.529,50	-20,00	164,50	SCHATZ 2Y	-0,192	-1,82	-5,20
OURO	1.908,24	5,64	46,66	T-NOTE 10Y	1,748	-1,97	7,00
TRIGO	619,25	-0,75	75,00	T-NOTE 2Y	0,741	-0,19	2,40
LICENÇA C02	24,26	0,41	-1,91	GILT 10Y	0,339	-4,63	4,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1832	0,11%	1,39%	1,1858	1,1882	1,1932
EUR/GBP	0,90718	0,04%	-0,23%	0,9086	0,9100	0,9129
EUR/JPY	123,74	0,32%	-0,58%	123,74	123,74	123,74
EUR/CHF	1,0724	-0,05%	0,49%	1,0716	1,0709	1,0695
EUR/BRL	6,6868	-0,67%	-1,23%	6,7090	6,7437	6,8619
EUR/PLN	4,5818	-0,04%	0,08%	4,5909	4,5992	4,6162



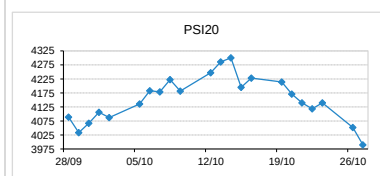
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1832	0,9072	123,74	1,0724	10,2901	7,4404	1,5557	1,65594	6,6868	10,8116
USD	0,8457	-	0,7666	104,515	0,9071	8,7207	6,2924	1,3168	1,4014	5,6468	9,1664

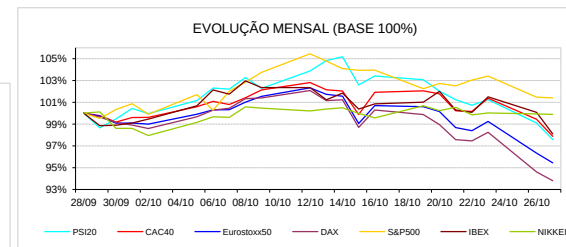
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,240	-4,26	-42,96
BCP	0,073	-2,79	-63,95
CORT. AMORIM	10,080	0,80	-10,80
CTT	2,190	-2,23	-31,35
EDP	4,333	0,30	14,74
EDP R	15,800	-1,13	50,48
GALP	7,434	-4,03	-50,11
IBERSOL	3,930	1,29	-50,88
J MARTINS	14,335	-1,04	-2,25
MOTA ENGIL	1,144	1,06	-38,82
NAVIGATOR	1,864	-2,92	-45,95
NOS	2,928	-2,92	-39,00
PHAROL	0,094	-1,67	-5,62
RAMADA	3,000	1,01	-48,63
REN	2,315	-1,07	-14,89
SEMAPA	6,600	-2,51	-51,90
SONAE CAP.	0,770	0,00	2,26
SONAE SGPS	0,502	-1,38	-44,89

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	1,29
MOTA ENGIL	1,06
RAMADA	1,01
CORT. AMORIM	0,80
EDP	0,30
BCP	-2,79
NAVIGATOR	-2,92
NOS	-2,92
GALP	-4,03
ALTRI	-4,26



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	3.989,63	-1,53%	-23,48%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.740,31	-1,57%	-20,70%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.076,31	-0,93%	-17,86%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.073,39	-0,85%	-8,87%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.398,67	-0,07%	5,20%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.662,10	-1,98%	-30,23%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.485,80	-0,04%	-0,72%	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.