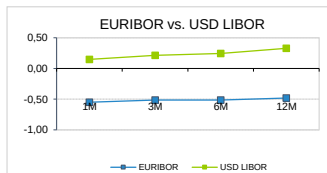


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

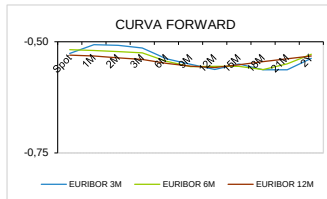
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5500	-1	-3	1M	0,1478	0	0	0,0431
3M	-0,5150	0	-2	3M	0,2144	0	-1	0,0481
6M	-0,5150	-1	-4	6M	0,2441	0	-3	0,0580
12M	-0,4820	-1	-5	12M	0,3276	0	-4	0,1251

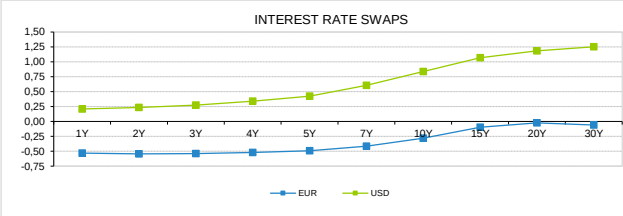


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5303	-1	-5	-0,5598	-0,4611	-0,2779
2Y	-0,5440	-1	-5	-0,5449	-0,4203	-0,2275
3Y	-0,5396	-1	-6	-0,5167	-0,3729	-0,1760
4Y	-0,5197	-1	-6	-0,4823	-0,3244	-0,1258
5Y	-0,4915	-1	-5	-0,4413	-0,2737	-0,0765
7Y	-0,4153	-1	-5	-0,3507	-0,1726	0,0101
10Y	-0,2804	0	-3	-0,2092	-0,0480	0,0972
15Y	-0,0962	0	-3	-0,0487	0,0490	0,1281
20Y	-0,0241	1	-2	-0,0005	0,0490	0,0844
30Y	-0,0594	1	-2	-0,0537	-0,0376	-0,0310

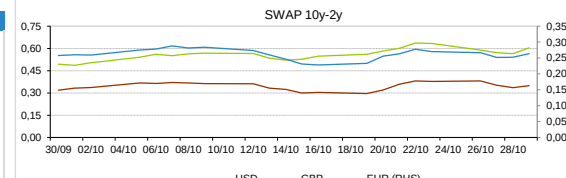
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2092	0	-1	0,2539	0,5309	0,9665
2Y	0,2340	0	1	0,3034	0,6450	1,0430
3Y	0,2731	1	4	0,3812	0,7240	1,1275
4Y	0,3391	2	7	0,4650	0,8602	1,2143
5Y	0,4244	2	10	0,5762	0,9320	1,2705
7Y	0,6058	3	13	0,7520	1,0740	1,3170
10Y	0,8379	4	16	0,9565	1,2090	1,3880
15Y	1,0679	4	17	1,1145	1,3155	1,4400
20Y	1,1840	4	18	1,2360	1,3753	1,4669
30Y	1,2525	4	18	1,2535	1,3419	1,3847

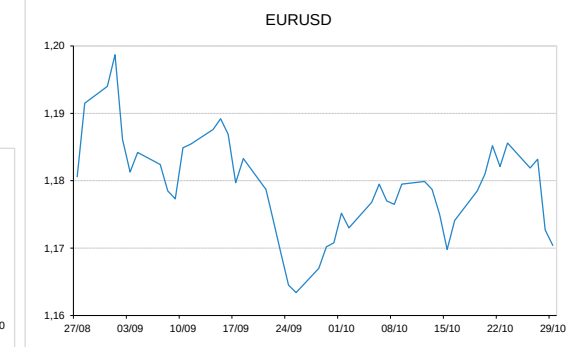
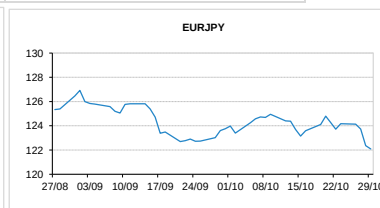
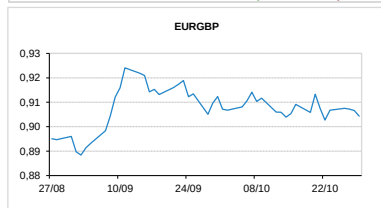


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	37,50	-1,62	-4,06	OT 2Y	-0,598	-0,02	-1,80
JETFUEL	315,00	-16,50	-8,25	OT 5Y	-0,402	-0,04	-17,00
DIESEL	316,75	-14,75	-18,50	OT 10Y	0,104	-0,05	-13,40
COBRE	6,746,00	-50,00	176,00	BUND 10Y	-1,155	-1,67	-9,70
ZINCO	2,520,00	-14,50	91,25	SCHATZ 2Y	-0,224	-1,82	-8,40
OURO	1,869,94	-11,15	-25,69	T-NOTE 10Y	1,774	2,11	10,90
TRIGO	605,25	-3,50	55,75	T-NOTE 2Y	0,741	0,37	3,00
LICENÇA C02	23,92	0,89	-2,87	GILT 10Y	0,326	0,60	3,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1704	-0,20%	0,02%	1,1730	1,1754	1,1803
EUR/GBP	0,9043	0,26%	0,59%	0,9057	0,9071	0,9100
EUR/JPY	122,09	0,22%	1,25%	122,09	122,09	122,09
EUR/CHF	1,0686	0,04%	0,99%	1,0679	1,0672	1,0658
EUR/BRL	6,7325	0,32%	-1,73%	6,7401	6,7685	6,8952
EUR/PLN	4,6174	0,18%	-1,87%	4,6266	4,6350	4,6522



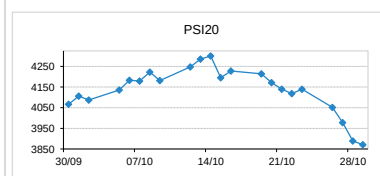
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1704	0,9043	122,09	1,0686	10,4089	7,4457	1,5565	1,66169	6,7325	11,1356
USD	0,8561	-	0,7737	104,455	0,9150	8,9120	6,3739	1,3333	1,4200	5,7729	9,5183

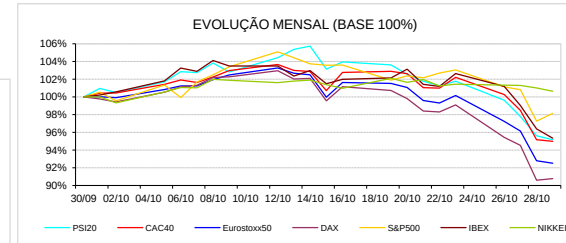
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,210	-2,01	-43,49
BCP	0,070	-0,71	-65,58
CORT. AMORIM	9,560	-2,45	-15,40
CTT	2,095	-0,48	-34,33
EDP	4,137	-0,72	9,55
EDP R	15,920	2,85	51,43
GALP	6,820	-0,55	-54,20
IBERSOL	3,630	0,00	-54,63
J MARTINS	13,825	-1,53	-5,73
MOTA ENGIL	1,082	-0,37	-42,14
NAVIGATOR	1,864	-2,75	-45,74
NOS	2,938	-0,07	-38,79
PHAROL	0,089	-1,34	-11,04
RAMADA	2,970	2,41	-49,14
REN	2,210	-2,00	-18,75
SEMAPA	6,440	-2,27	-52,99
SONAE CAP.	0,770	0,00	2,26
SONAE SGPS	0,491	-1,82	-46,00

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP R	2,85
RAMADA	2,41
REN	-2,00
ALTRI	-2,01
SEMAPA	-2,27
CORT. AMORIM	-2,45
NAVIGATOR	-2,75



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	3.866,29	-0,47%	-25,77%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.566,63	-0,19%	-23,68%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.957,66	-0,31%	-21,11%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	11.596,15	0,19%	-12,58%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.301,04	0,90%	2,16%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.403,50	-1,10%	-32,94%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.331,94	-0,37%	-1,37%	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.