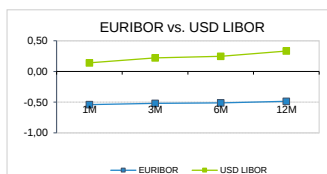


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

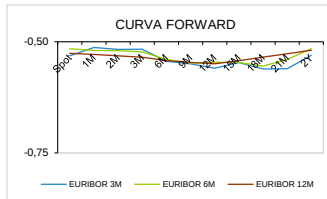
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5400	0	-1	1M	0,1405	0	0	0,0418
3M	-0,5200	0	-2	3M	0,2201	0	-1	0,0435
6M	-0,5130	0	-4	6M	0,2460	0	0	0,0605
12M	-0,4860	0	-4	12M	0,3324	0	-3	0,1220

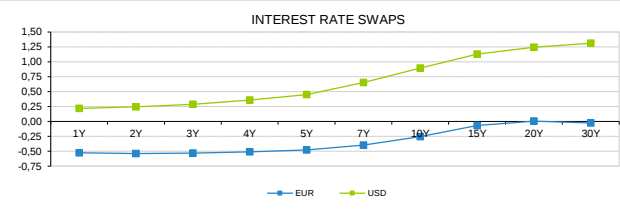


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5260	0	-3	-0,5496	-0,4415	-0,2501
2Y	-0,5382	0	-4	-0,5354	-0,3980	-0,1948
3Y	-0,5319	1	-5	-0,5040	-0,3490	-0,1424
4Y	-0,5092	1	-5	-0,4656	-0,2952	-0,0894
5Y	-0,4778	1	-5	-0,4222	-0,2439	-0,0385
7Y	-0,3968	1	-4	-0,3263	-0,1405	0,0450
10Y	-0,2558	1	-3	-0,1820	-0,0155	0,1310
15Y	-0,0685	1	-4	-0,0187	0,0822	0,1615
20Y	0,0050	1	-4	0,0305	0,0835	0,1195
30Y	-0,0273	1	-4	-0,0198	-0,0013	0,0071

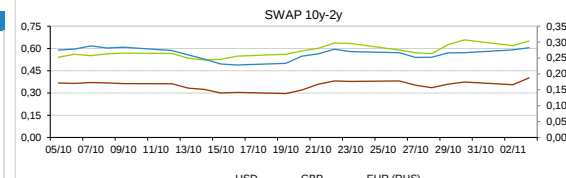
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2181	1	0	0,2655	0,5660	1,0510
2Y	0,2455	1	2	0,3176	0,6890	1,1711
3Y	0,2873	1	3	0,3997	0,7955	1,2360
4Y	0,3575	2	5	0,5030	0,9180	1,3083
5Y	0,4512	2	7	0,5995	1,0223	1,3630
7Y	0,6519	3	11	0,8163	1,1683	1,4393
10Y	0,8959	4	13	1,0205	1,3046	1,5003
15Y	1,1300	5	14	1,2263	1,3920	1,5433
20Y	1,2452	5	13	1,3138	1,4444	1,5160
30Y	1,3125	5	13	1,3512	1,4177	1,4699

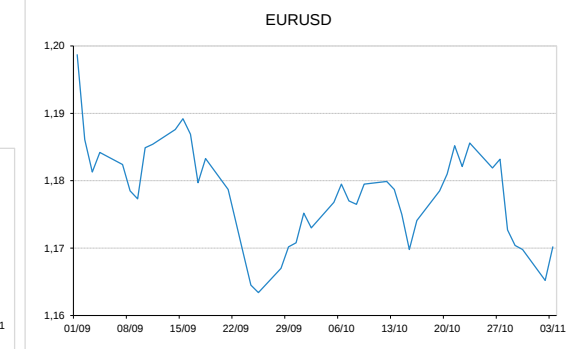
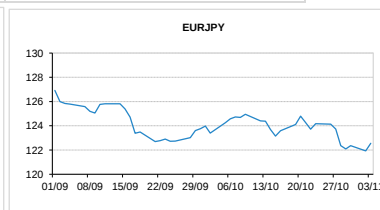
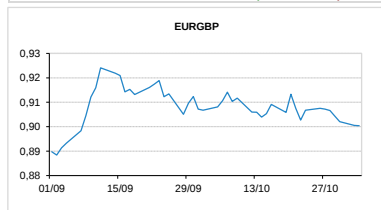


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	39,62	0,65	-0,19	OT 2Y	-0,612	0,00	-3,80
JETFUEL	317,61	8,36	7,35	OT 5Y	-0,423	-0,01	-16,90
DIESEL	316,11	9,36	-0,69	OT 10Y	0,082	-0,01	-13,80
COBRE	6.773,00	43,50	209,00	BUND 10Y	-1,137	1,27	-9,40
ZINCO	2.529,75	14,50	211,75	SCHATZ 2Y	-0,213	0,23	-7,30
OURO	1.907,26	13,60	7,42	T-NOTE 10Y	1,825	2,69	12,90
TRIGO	609,00	1,50	35,75	T-NOTE 2Y	0,761	1,30	3,70
LICENÇA C02	24,46	0,79	-2,57	GILT 10Y	0,380	4,97	2,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1702	0,43%	-0,56%	1,1728	1,1753	1,1803
EUR/GBP	0,90042	0,01%	0,85%	0,9018	0,9032	0,9062
EUR/JPY	122,56	-0,51%	1,38%	122,56	122,56	122,56
EUR/CHF	1,0697	0,04%	0,89%	1,0689	1,0683	1,0669
EUR/BRL	6,7222	-0,44%	-2,21%	6,7563	6,7950	6,9305
EUR/PLN	4,5401	1,55%	-1,11%	4,5486	4,5561	4,5721



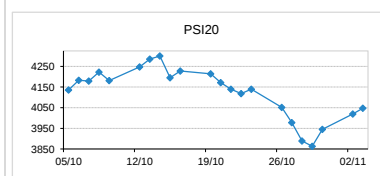
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1702	0,9004	122,56	1,0697	10,3596	7,4469	1,5391	1,63605	6,7222	10,9898
USD	0,8524	-	0,7652	104,55	0,9123	8,8357	6,3472	1,3107	1,3952	5,7018	9,3528

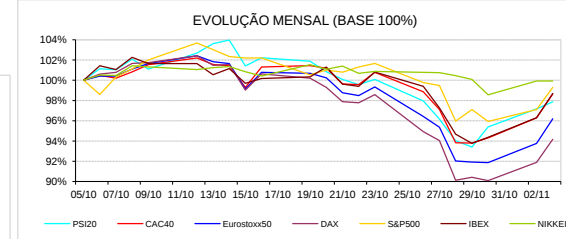
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,466	0,58	-38,98
BCP	0,078	0,91	-61,79
CORT. AMORIM	9,840	-1,20	-12,92
CTT	2,245	1,13	-29,62
EDP	4,318	1,24	14,34
EDP R	16,740	3,21	59,43
GALP	7,338	0,58	-50,75
IBERSOL	3,900	-1,27	-51,25
J MARTINS	13,680	-1,16	-6,72
MOTA ENGIL	1,130	1,25	-39,57
NAVIGATOR	1,948	-1,62	-43,51
NOS	3,002	-0,40	-37,46
PHAROL	0,094	3,77	-6,02
RAMADA	3,000	0,00	-48,63
REN	2,305	1,32	-15,26
SEMAPA	6,750	-0,59	-50,80
SONAE CAP.	0,770	0,00	2,26
SONAE SGPS	0,522	-0,38	-42,69

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	3,77
EDP R	3,21
REN	1,32
MOTA ENGIL	1,25
EDP	1,24
SEMAPA	-0,59
J MARTINS	-1,16
CORT. AMORIM	-1,20
IBERSOL	-1,27
NAVIGATOR	-1,62



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.047,75	0,71%	-22,37%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.805,77	2,44%	-19,61%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.097,63	2,59%	-17,29%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.079,31	2,47%	-8,83%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.384,29	2,24%	4,76%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.748,20	2,47%	-29,33%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.295,48	1,39%	-1,53%	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.