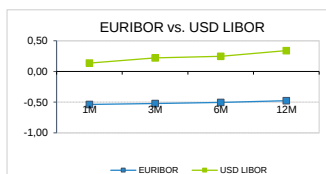


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

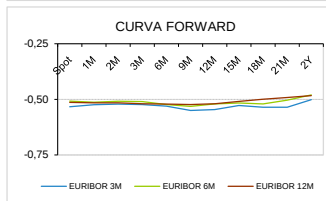
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATE								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5370	0	0	1M	0,1364	0	-1	0,0435
3M	-0,5220	-1	-1	3M	0,2220	0	-1	0,0464
6M	-0,5050	0	-1	6M	0,2460	-1	-1	0,0668
12M	-0,4760	-1	-1	12M	0,3394	0	-1	0,1360

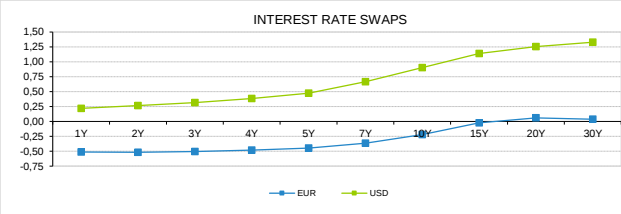


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5135	0	0	-0,5201	-0,4039	-0,2181
2Y	-0,5173	0	1	-0,5016	-0,3591	-0,1641
3Y	-0,5058	0	2	-0,4698	-0,3116	-0,1094
4Y	-0,4800	0	3	-0,4310	-0,2627	-0,0545
5Y	-0,4462	0	4	-0,3878	-0,2112	-0,0030
7Y	-0,3645	0	5	-0,2939	-0,1030	0,0890
10Y	-0,2215	0	8	-0,1426	0,0305	0,1830
15Y	-0,0244	0	10	0,0304	0,1390	0,2260
20Y	0,0595	-1	11	0,0891	0,1479	0,1900
30Y	0,0367	-1	11	0,0465	0,0684	0,0801

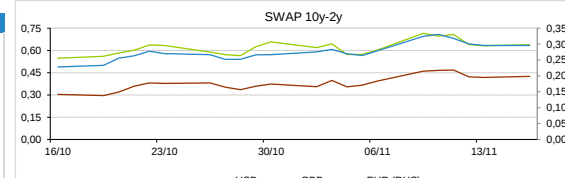
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2195	0	1	0,3026	0,5921	1,0648
2Y	0,2650	0	3	0,3435	0,7166	1,1390
3Y	0,3151	1	5	0,4375	0,8325	1,2312
4Y	0,3844	1	6	0,5342	0,9230	1,2973
5Y	0,4740	1	7	0,6409	1,0125	1,3540
7Y	0,6650	1	10	0,8215	1,1515	1,4170
10Y	0,9034	1	12	1,0425	1,3067	1,4815
15Y	1,1400	1	14	1,2225	1,3995	1,5250
20Y	1,2566	1	14	1,3110	1,4400	1,5510
30Y	1,3290	1	15	1,3515	1,4385	1,4795

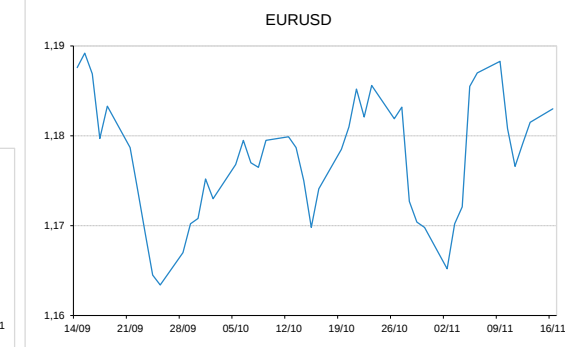
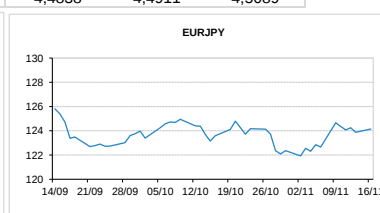
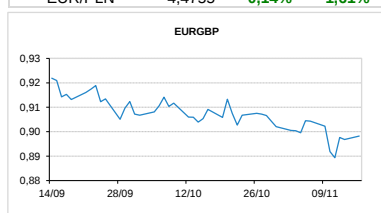


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	44,12	1,34	0,85	OT 2Y	-0,623	-0,02	-3,30
JETFUEL	353,25	-8,75	14,50	OT 5Y	-0,398	-0,02	-6,80
DIESEL	345,00	-6,75	3,50	OT 10Y	0,076	-0,01	-7,00
COBRE	7.000,00	48,50	290,50	BUND 10Y	-1,062	0,07	6,50
ZINCO	2.614,75	4,50	209,25	SCHATZ 2Y	-0,140	0,46	5,40
OURO	1.894,88	5,68	-4,41	T-NOTE 10Y	1,823	0,71	9,90
TRIGO	602,00	0,00	-21,50	T-NOTE 2Y	0,772	0,19	3,90
LICENÇA C02	27,23	0,95	2,34	GILT 10Y	0,451	0,78	16,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,183	0,13%	0,76%	1,1857	1,1881	1,1931
EUR/GBP	0,89819	-0,15%	1,22%	0,8996	0,9009	0,9038
EUR/JPY	124,15	-0,22%	-0,45%	124,15	124,15	124,15
EUR/CHF	1,0802	-0,01%	-0,75%	1,0795	1,0788	1,0774
EUR/BRL	6,4139	0,77%	3,16%	6,4432	6,4785	6,5998
EUR/PLN	4,4755	0,14%	1,61%	4,4838	4,4911	4,5089



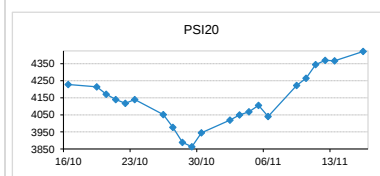
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1830	0,8982	124,15	1,0802	10,2252	7,4469	1,5477	1,61759	6,4139	10,7456
USD	0,8450	-	0,759	104,605	0,9127	8,6311	6,2920	1,3072	1,3664	5,4302	9,0569

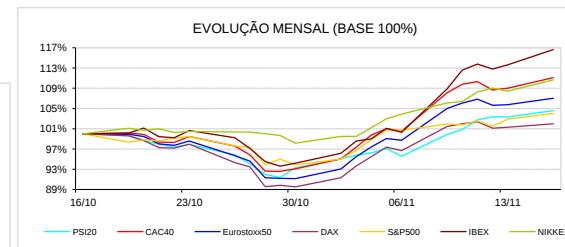
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,048	3,58	-28,73
BCP	0,106	5,92	-47,93
CORT. AMORIM	10,300	0,98	-8,85
CTT	2,280	4,83	-28,53
EDP	4,495	-1,12	19,03
EDP R	17,120	-1,50	63,05
GALP	9,116	5,39	-38,82
IBERSOL	4,510	4,88	-43,63
J MARTINS	14,145	-0,25	-3,55
MOTA ENGIL	1,318	6,29	-29,52
NAVIGATOR	2,312	4,24	-32,96
NOS	2,870	-1,78	-40,21
PHAROL	0,107	5,74	7,23
RAMADA	3,370	4,33	-42,29
REN	2,330	-0,43	-14,34
SEMAPA	7,930	3,66	-42,20
SONAE CAP.	0,770	0,00	2,26
SONAE SGPS	0,632	2,35	-30,60

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
MOTA ENGIL	6,29
BCP	5,92
PHAROL	5,74
GALP	5,39
IBERSOL	4,88
J MARTINS	-0,25
REN	-0,43
EDP	-1,12
EDP R	-1,50
NOS	-1,78



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.421,85	1,25%	-15,20%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.483,31	1,92%	-8,28%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.473,54	1,21%	-7,25%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.164,38	0,67%	-0,64%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.624,09	1,08%	12,17%	3.645,99	2.191,86
IBEX 35	7.989,80	2,65%	-16,33%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	25.906,93	2,05%	9,51%	25.928,18	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.