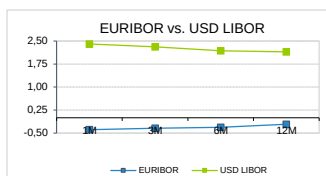


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

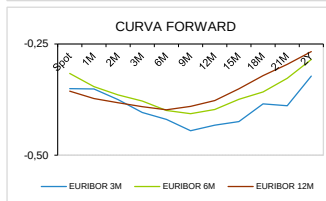
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,3880	0	-2	1M	2,4041	0	-2	0,7218
3M	-0,3430	0	-3	3M	2,3113	-2	-21	0,7720
6M	-0,3110	0	-7	6M	2,1828	-3	-37	0,8581
12M	-0,2110	0	-6	12M	2,1474	-3	-47	0,9584

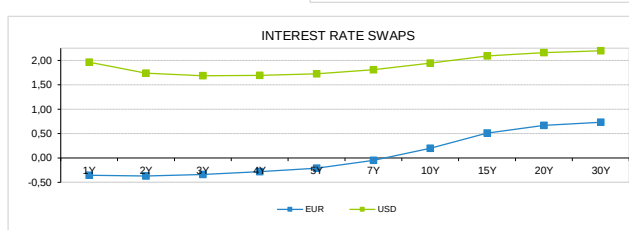


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3560	0	-10	-0,3786	-0,1001	0,2661
2Y	-0,3700	-1	-12	-0,3219	-0,0058	0,3565
3Y	-0,3400	-1	-14	-0,2477	0,0850	0,4460
4Y	-0,2820	-1	-15	-0,1637	0,1750	0,5370
5Y	-0,2090	-1	-16	-0,0774	0,2640	0,6155
7Y	-0,0490	-1	-18	0,0960	0,4350	0,7450
10Y	0,1990	-1	-21	0,3410	0,6301	0,8810
15Y	0,5090	-2	-24	0,6085	0,8078	0,9770
20Y	0,6670	-2	-26	0,7380	0,8738	0,9786
30Y	0,7320	-2	-28	0,7745	0,8512	0,9060

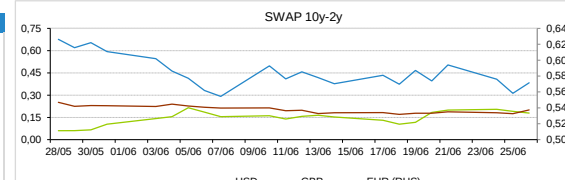
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,25
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,9640	-6	-43	1,5628	1,7177	1,9934
2Y	1,7390	-8	-45	1,5610	1,7866	2,0280
3Y	1,6860	-8	-43	1,5725	1,8010	2,0800
4Y	1,6930	-16	-41	1,6265	1,8700	2,1290
5Y	1,7250	-7	-39	1,7230	1,9190	2,1926
7Y	1,8110	-6	-35	1,8280	2,0408	2,1995
10Y	1,9450	-6	-32	1,9957	2,1317	2,2445
15Y	2,0920	-5	-29	2,1140	2,2330	2,3260
20Y	2,1610	-5	-28	2,1942	2,2620	2,2910
30Y	2,1980	-5	-27	2,1550	2,2600	2,2940

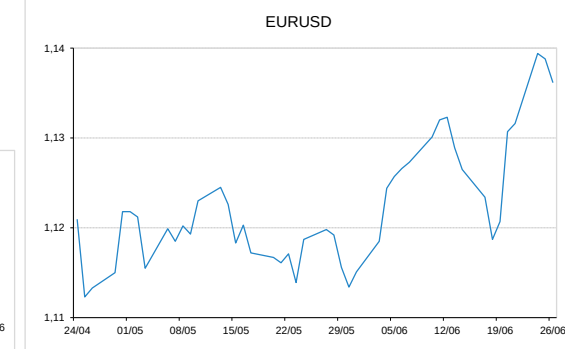
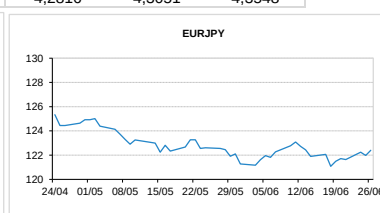


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	66,50	1,45	-0,97	OT 2Y	-0,419	0,01	-2,40
JETFUEL	630,00	9,41	-9,91	OT 5Y	-0,152	0,00	-16,50
DIESEL	593,00	9,66	-17,16	OT 10Y	0,477	-0,01	-48,50
COBRE	6.015,50	82,00	87,00	BUND 10Y	-0,894	3,10	-16,80
ZINCO	2.611,50	56,50	6,50	SCHATZ 2Y	-0,112	1,37	-8,20
OURO	1.412,13	-13,59	127,55	T-NOTE 10Y	2,801	3,88	-25,70
TRIGO	547,00	7,00	50,25	T-NOTE 2Y	2,103	4,59	-34,90
LICENÇA C02	27,44	1,03	1,97	GILT 10Y	0,825	3,94	-13,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1362	-0,23%	1,46%	1,1446	1,1520	1,1663
EUR/GBP	0,89603	-0,13%	-1,54%	0,8989	0,9020	0,9084
EUR/JPY	122,4	-0,35%	0,13%	122,40	122,40	122,40
EUR/CHF	1,1113	-0,19%	1,13%	1,1101	1,1090	1,1066
EUR/BRL	4,3759	-0,01%	3,34%	4,4446	4,5084	4,6399
EUR/PLN	4,2595	-0,08%	0,69%	4,2816	4,3051	4,3548



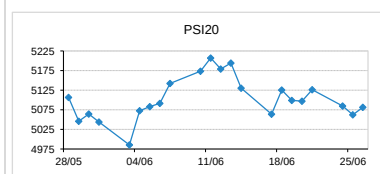
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1362	0,8960	122,40	1,1113	10,5330	7,4647	1,4929	1,62881	4,3759	9,6587
USD	0,8790	-	0,7887	107,63	0,9754	9,2587	6,5616	1,3140	1,4322	3,8466	8,4903

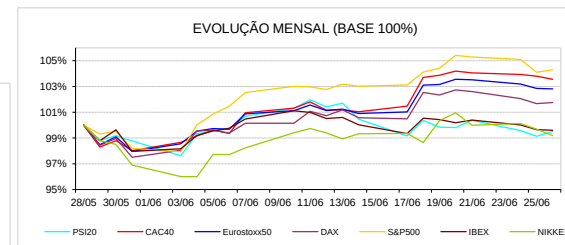
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,045	3,42	4,22
BCP	0,263	0,77	14,47
CORT. AMORIM	10,220	-0,97	13,56
CTT	2,068	1,57	-29,80
EDP	3,348	-0,06	9,81
EDP R	8,960	-0,44	15,24
GALP	13,460	2,12	-2,43
IBERSOL	7,960	0,25	0,76
J MARTINS	13,975	-1,86	35,15
MOTA ENGIL	1,850	0,87	14,91
NAVIGATOR	3,314	1,91	-7,94
NOS	5,760	0,44	8,88
NOVABASE	2,370	1,28	17,33
PHAROL	0,149	0,00	-8,70
RAMADA	7,180	1,13	-4,27
REN	12,400	2,15	-5,50
SEMAPA	0,713	3,18	-16,02
SONAE CAP.	0,825	-0,12	1,85
SONAE SGPS	7,180	1,13	-4,27

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
ALTRI	3,42
SEMAPA	3,18
REN	2,15
GALP	2,12
NAVIGATOR	1,91
EDP	-0,06
SONAE CAP.	-0,12
EDP R	-0,44
CORT. AMORIM	-0,97
J MARTINS	-1,86



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.081,18	0,38%	7,40%	5.686,45	4.551,84
CAC40	5.499,83	-0,23%	16,30%	5.601,38	4.555,99
ESTX 50 PR	3.441,66	-0,04%	14,71%	3.536,87	2.908,70
XTRA DAX	12.237,75	0,08%	15,91%	12.886,83	10.279,20
S&P 500	2.922,86	0,19%	16,60%	2.964,15	2.346,58
IBEX 35	9.155,40	-0,05%	7,21%	9.971,60	8.286,20
NIKKEI 225	21.086,59	-0,51%	5,36%	24.448,07	18.948,58



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.