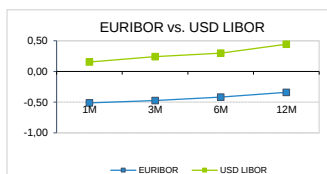


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

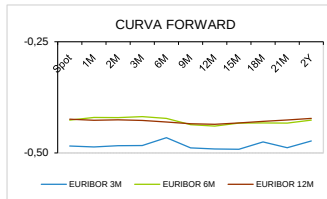
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5120	0	0	1M	0,1535	0	-1	0,0605
3M	-0,4740	-1	-3	3M	0,2420	-1	-3	0,0716
6M	-0,4170	0	-11	6M	0,2984	-1	-7	0,1436
12M	-0,3400	0	-10	12M	0,4435	-1	-6	0,2931

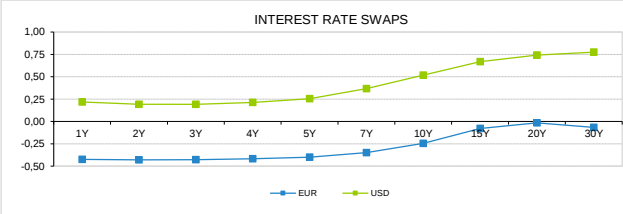


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4240	0	-7	-0,4356	-0,3884	-0,2666
2Y	-0,4297	0	-5	-0,4299	-0,3600	-0,2252
3Y	-0,4270	-1	-4	-0,4144	-0,3287	-0,1841
4Y	-0,4168	-1	-4	-0,3949	-0,2923	-0,1400
5Y	-0,3997	-2	-5	-0,3692	-0,2540	-0,0910
7Y	-0,3487	-2	-7	-0,3039	-0,1702	-0,0107
10Y	-0,2445	-2	-8	-0,1875	-0,0520	0,0762
15Y	-0,0782	-2	-10	-0,0391	0,0409	0,1087
20Y	-0,0158	-2	-11	0,0013	0,0348	0,0568
30Y	-0,0672	-2	-13	-0,0682	-0,0604	-0,0573

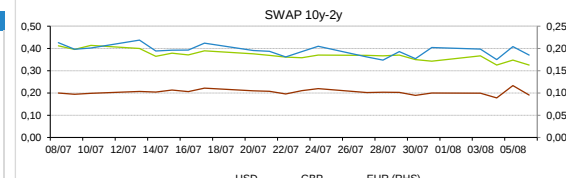
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2183	0	-4	0,1716	0,2790	0,5905
2Y	0,1921	0	-3	0,1779	0,3415	0,6460
3Y	0,1922	0	-5	0,2125	0,4225	0,6990
4Y	0,2129	-1	-7	0,2652	0,4820	0,7400
5Y	0,2539	-1	-9	0,3242	0,5560	0,7873
7Y	0,3672	-2	-12	0,4470	0,6380	0,8437
10Y	0,5175	-2	-15	0,5932	0,7554	0,8857
15Y	0,6688	-3	-17	0,7015	0,8200	0,9167
20Y	0,7427	-3	-18	0,7789	0,8524	0,9100
30Y	0,7750	-3	-19	0,7908	0,8226	0,8440

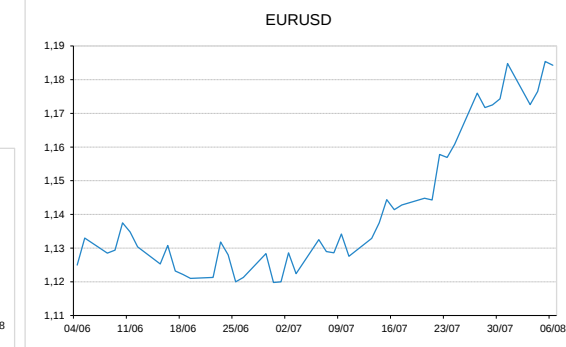
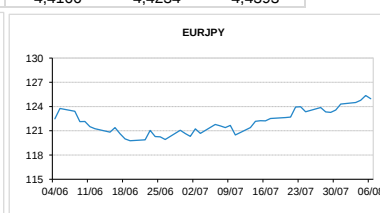
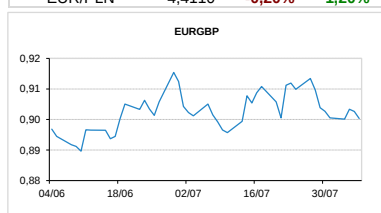


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	45,22	0,05	1,98	OT 2Y	-0,454	0,00	3,20
JETFUEL	358,59	3,51	14,05	OT 5Y	-0,201	-0,02	-8,70
DIESEL	382,09	4,01	12,10	OT 10Y	0,303	-0,02	-10,30
COBRE	6.486,00	41,50	477,50	BUND 10Y	-1,242	-3,44	-11,60
ZINCO	2.400,75	68,75	380,25	SCHATZ 2Y	-0,060	-0,69	-2,80
OURO	2.056,03	23,92	272,54	T-NOTE 10Y	1,619	-1,95	-9,80
TRIGO	503,50	-7,25	10,25	T-NOTE 2Y	0,713	-0,55	-4,40
LICENÇA C02	26,40	-0,37	-3,30	GILT 10Y	0,129	-2,68	-8,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1843	-0,09%	4,57%	1,1865	1,1891	1,1934
EUR/GBP	0,90033	0,26%	0,52%	0,9017	0,9031	0,9061
EUR/JPY	124,96	0,33%	-2,54%	124,96	124,96	124,96
EUR/CHF	1,0787	-0,15%	-1,32%	1,0780	1,0771	1,0759
EUR/BRL	6,3487	-1,11%	-4,61%	6,3766	6,4035	6,4696
EUR/PLN	4,4110	-0,20%	1,20%	4,4166	4,4234	4,4393



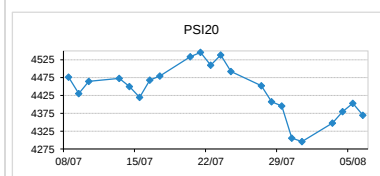
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1843	0,9003	124,96	1,0787	10,3136	7,4506	1,5759	1,64058	6,3487	10,6463
USD	0,8445	-	0,7608	105,525	0,9110	8,6970	6,2915	1,3301	1,3857	5,3516	8,9854

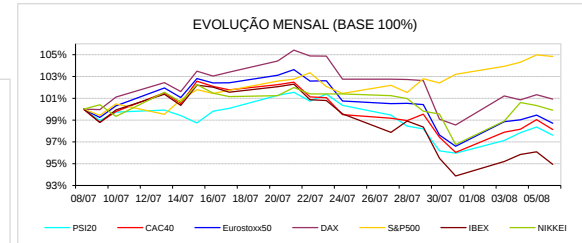
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,372	-0,86	-23,03
BCP	0,102	-1,46	-49,95
CORT. AMORIM	9,930	-1,29	-12,12
CTT	2,510	-2,33	-21,32
EDP	4,401	0,11	16,54
EDP R	13,800	-0,58	31,43
GALP	9,320	-0,70	-37,45
IBERSOL	5,260	-0,75	-34,25
J MARTINS	14,080	-1,57	-3,99
MOTA ENGIL	1,252	-1,26	-33,05
NAVIGATOR	2,198	-0,18	-36,26
NOS	3,682	-1,55	-23,29
PHAROL	0,115	0,35	15,86
RAMADA	3,170	-1,25	-45,72
REN	2,450	0,20	-9,93
SEMAPA	8,000	-0,12	-41,69
SONAE CAP.	0,664	0,30	-11,82
SONAE SGPS	0,600	-0,83	-34,07

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	0,35
SONAE CAP.	0,30
REN	0,20
EDP	0,11
CORT. AMORIM	-1,29
BCP	-1,46
NOS	-1,55
J MARTINS	-1,57
CTT	-2,33



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.369,68	-0,76%	-16,20%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.888,36	-0,91%	-18,23%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.243,50	-0,76%	-13,39%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.610,85	-0,39%	-4,82%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.323,74	-0,14%	2,86%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.956,10	-1,19%	-27,16%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.418,15	-0,43%	-5,24%	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.