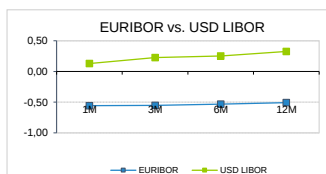


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

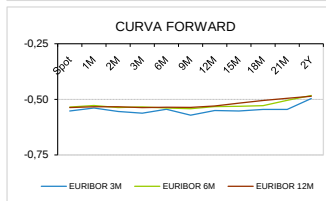
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5570	1	1	1M	0,1289	0	-2	0,0284
3M	-0,5520	0	-1	3M	0,2256	-2	1	0,0311
6M	-0,5320	0	-1	6M	0,2513	0	0	0,0395
12M	-0,5080	0	-1	12M	0,3258	0	-1	0,0771

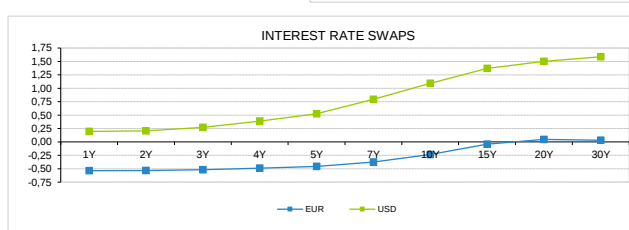


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5362	0	0	-0,5313	-0,4052	-0,2232
2Y	-0,5339	0	1	-0,5079	-0,3640	-0,1740
3Y	-0,5173	0	2	-0,4735	-0,3164	-0,1225
4Y	-0,4900	0	3	-0,4360	-0,2690	-0,0700
5Y	-0,4563	0	3	-0,3925	-0,2185	-0,0160
7Y	-0,3745	1	5	-0,3005	-0,1155	0,0710
10Y	-0,2340	1	6	-0,1556	0,0130	0,1625
15Y	-0,0415	1	7	0,0146	0,1231	0,2114
20Y	0,0470	1	8	0,0767	0,1362	0,1800
30Y	0,0305	2	9	0,0401	0,0622	0,0736

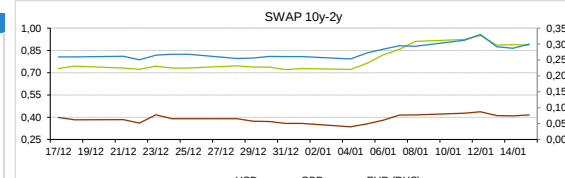
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,1953	0	0	0,2220	0,7291	1,3934
2Y	0,2065	0	0	0,3107	0,9010	1,4855
3Y	0,2710	-1	3	0,4400	1,0520	1,5690
4Y	0,3890	-1	6	0,5990	1,1917	1,6361
5Y	0,5249	-1	9	0,7490	1,2960	1,6943
7Y	0,7946	-1	14	1,0065	1,4531	1,7560
10Y	1,0916	-1	17	1,2696	1,6173	1,8190
15Y	1,3706	-1	20	1,4770	1,7090	1,8520
20Y	1,5002	0	20	1,5740	1,7694	1,8515
30Y	1,5870	0	21	1,6270	1,7350	1,7938

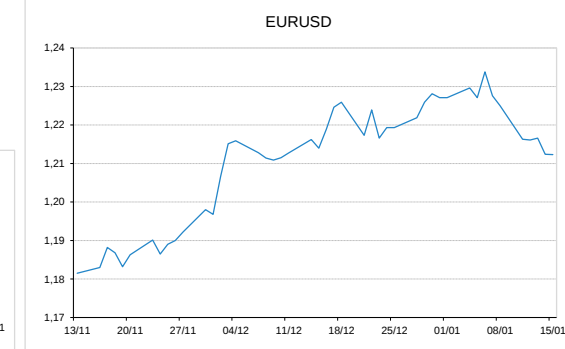
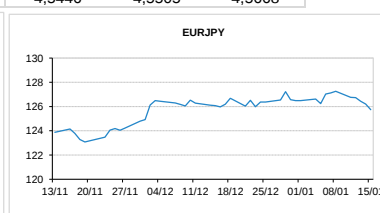


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	55,17	-1,25	4,46	OT 2Y	-0,660	-0,01	7,20
JETFUEL	481,25	4,71	48,25	OT 5Y	-0,434	0,01	3,50
DIESEL	466,75	4,74	46,50	OT 10Y	0,001	-0,01	0,70
COBRE	8.084,00	39,50	297,50	BUND 10Y	-1,242	1,39	-0,50
ZINCO	2.735,25	-16,25	-85,75	SCHATZ 2Y	-0,142	0,46	-0,20
OURO	1.831,82	-23,58	-18,64	T-NOTE 10Y	1,929	-2,72	9,40
TRIGO	668,75	-1,25	69,00	T-NOTE 2Y	0,728	-0,92	1,10
LICENÇA C02	32,05	-1,48	-0,13	GILT 10Y	0,474	0,35	1,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2123	-0,01%	-0,14%	1,2148	1,2172	1,2227
EUR/GBP	0,88998	-0,06%	2,02%	0,8913	0,8926	0,8953
EUR/JPY	125,74	0,37%	0,27%	125,74	125,74	125,74
EUR/CHF	1,0761	0,21%	0,11%	1,0755	1,0748	1,0735
EUR/BRL	6,3342	-0,08%	-2,41%	6,3636	6,4064	6,5484
EUR/PLN	4,5394	0,09%	-2,15%	4,5446	4,5505	4,5668



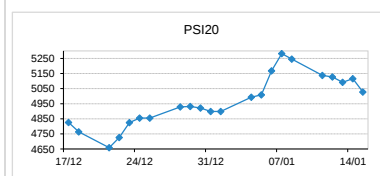
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2123	0,8900	125,74	1,0761	10,1312	7,4380	1,5384	1,56643	6,3342	10,3323
USD	0,8270	-	0,7363	103,875	0,8903	8,3828	6,1525	1,2760	1,2988	5,2703	8,5554

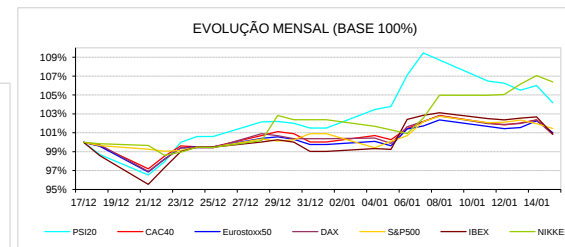
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,035	-3,08	-2,42
BCP	0,130	-3,13	5,44
CORT. AMORIM	11,140	-2,45	-3,97
CTT	2,455	-0,61	4,47
EDP	5,340	-1,00	3,57
EDP R	22,800	-2,98	0,00
GALP	8,972	-4,43	2,49
IBERSOL	4,970	-0,60	-7,96
J MARTINS	14,800	1,06	7,09
MOTA ENGIL	1,426	-2,19	4,55
NAVIGATOR	2,508	-1,49	0,40
NOVABASE	3,330	0,00	3,74
NOS	2,998	-1,38	4,90
PHAROL	0,139	-2,26	11,06
REN	2,385	-0,42	0,85
SEMAPA	8,760	-2,01	-2,67
SONAE SGPS	0,722	1,69	9,15

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE SGPS	1,69
J MARTINS	1,06
CORT. AMORIM	-2,45
EDP R	-2,98
ALTRI	-3,08
BCP	-3,13
GALP	-4,43



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.027,20	-1,73%	2,63%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.603,15	-1,37%	0,93%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.596,80	-1,22%	1,24%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.780,27	-1,49%	0,45%	14.131,52	8.255,65
S&P 500	3.776,42	-0,50%	0,55%	3.826,69	2.191,86
IBEX 35	8.224,10	-1,77%	1,86%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	28.519,18	-0,62%	3,92%	28.979,53	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.