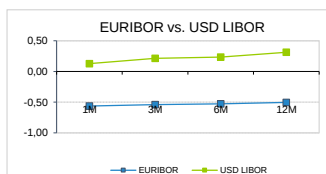


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

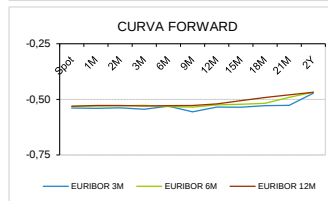
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5630	-1	1	1M	0,1275	0	-2	0,0263
3M	-0,5390	0	0	3M	0,2129	0	-3	0,0334
6M	-0,5280	-1	-1	6M	0,2330	0	-3	0,0411
12M	-0,5040	-1	-1	12M	0,3123	0	-3	0,0810

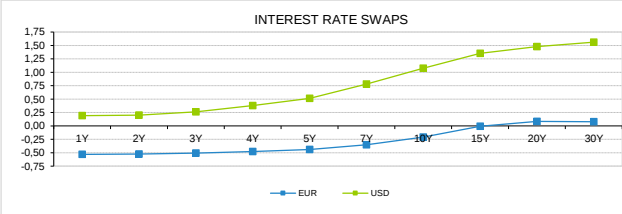


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5310	0	-1	-0,5217	-0,3857	-0,1965
2Y	-0,5258	0	-2	-0,4973	-0,3380	-0,1410
3Y	-0,5075	0	-2	-0,4598	-0,2900	-0,0864
4Y	-0,4770	1	0	-0,4170	-0,2386	-0,0331
5Y	-0,4390	1	1	-0,3725	-0,1864	0,0145
7Y	-0,3518	2	3	-0,2744	-0,0820	0,1098
10Y	-0,2074	2	5	-0,1263	0,0500	0,2030
15Y	-0,0082	2	6	0,0513	0,1673	0,2570
20Y	0,0843	2	7	0,1198	0,1857	0,2320
30Y	0,0788	2	10	0,0915	0,1177	0,1326

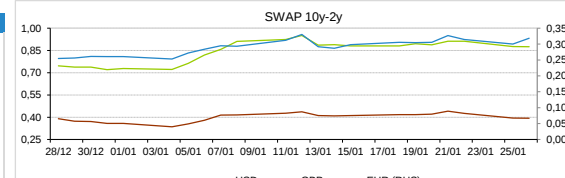
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,1913	0	-1	0,2155	0,7346	1,3662
2Y	0,2005	0	-1	0,3015	0,8938	1,4703
3Y	0,2626	0	1	0,4330	1,0496	1,5512
4Y	0,3794	0	3	0,5950	1,1793	1,6173
5Y	0,5124	0	5	0,7310	1,2827	1,6723
7Y	0,7795	0	10	0,9948	1,4420	1,7574
10Y	1,0753	0	12	1,2517	1,5894	1,8192
15Y	1,3526	0	13	1,4718	1,7005	1,8519
20Y	1,4781	0	13	1,5656	1,7327	1,8441
30Y	1,5606	0	12	1,5940	1,7109	1,7611

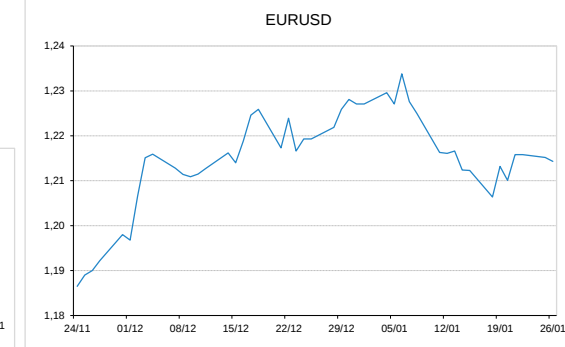
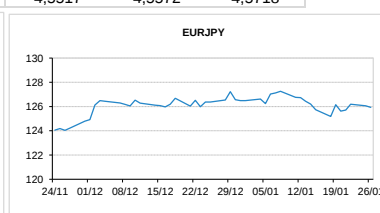


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	55,88	0,00	4,54	OT 2Y	-0,669	-0,01	6,40
JETFUEL	466,75	4,75	26,25	OT 5Y	-0,444	-0,01	-1,20
DIESEL	455,00	5,25	28,50	OT 10Y	0,024	0,00	-3,60
COBRE	8.005,50	-28,50	181,50	BUND 10Y	-1,236	1,98	-3,10
ZINCO	2.689,75	-11,00	-144,75	SCHATZ 2Y	-0,137	0,46	-2,30
OURO	1.852,84	-5,49	-26,89	T-NOTE 10Y	1,884	0,14	4,70
TRIGO	665,25	16,75	38,25	T-NOTE 2Y	0,713	0,00	0,00
LICENÇA C02	33,41	0,25	1,22	GILT 10Y	0,453	0,78	1,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2143	-0,07%	-0,62%	1,2167	1,2192	1,2246
EUR/GBP	0,88698	0,12%	1,93%	0,8883	0,8897	0,8923
EUR/JPY	125,93	0,10%	0,48%	125,93	125,93	125,93
EUR/CHF	1,0789	-0,04%	0,70%	1,0782	1,0775	1,0762
EUR/BRL	6,5264	1,71%	-1,82%	6,5568	6,6055	6,7611
EUR/PLN	4,5474	-0,13%	-1,18%	4,5517	4,5572	4,5718



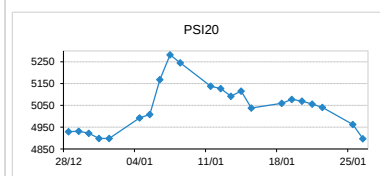
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2143	0,8870	125,93	1,0789	10,0897	7,4393	1,5454	1,57119	6,5264	10,3957
USD	0,8220	-	0,7277	103,645	0,8874	8,2917	6,1147	1,2706	1,2910	5,3562	8,5319

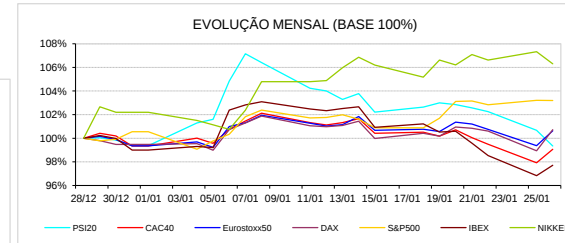
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,060	-0,20	-1,94
BCP	0,116	-0,60	-6,25
CORT. AMORIM	10,960	0,92	-5,52
CTT	2,410	0,00	2,55
EDP	5,220	-1,77	1,24
EDP R	23,400	-4,49	2,63
GALP	8,634	0,58	-1,37
IBERSOL	4,930	0,20	-8,70
J MARTINS	14,000	-1,58	1,30
MOTA ENGIL	1,390	0,72	1,91
NAVIGATOR	2,498	0,73	0,00
NOVABASE	3,340	0,60	4,05
NOS	2,874	-2,44	0,56
PHAROL	0,128	-2,29	2,56
REN	2,360	0,21	-0,21
SEMAPA	8,780	1,15	-2,44
SONAE SGPS	0,685	0,07	3,55

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SEMAPA	1,15
CORT. AMORIM	0,92
NAVIGATOR	0,73
MOTA ENGIL	0,72
NOVABASE	0,60
J MARTINS	-1,58
EDP	-1,77
PHAROL	-2,29
NOS	-2,44
EDP R	-4,49



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.896,95	-1,32%	-0,03%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.536,39	1,17%	-0,27%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.598,11	1,27%	1,28%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.891,25	1,81%	1,26%	14.131,52	8.255,65
S&P 500	3.855,31	-0,01%	2,63%	3.870,90	2.191,86
IBEX 35	7.969,40	0,91%	-1,29%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	28.546,18	-0,96%	4,02%	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.