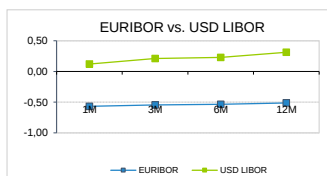


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

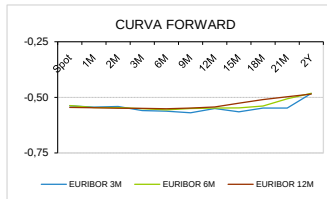
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5680	0	0	1M	0,1208	0	-2	0,0274
3M	-0,5440	0	0	3M	0,2115	-1	-3	0,0393
6M	-0,5340	-1	-1	6M	0,2276	-1	-4	0,0455
12M	-0,5130	-1	-2	12M	0,3120	0	-3	0,0850

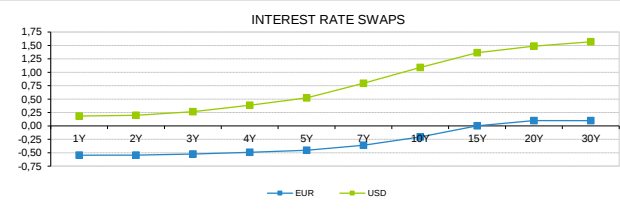


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5459	-1	-3	-0,5436	-0,4033	-0,1911
2Y	-0,5444	-1	-4	-0,5140	-0,3495	-0,1354
3Y	-0,5245	-1	-3	-0,4796	-0,2936	-0,0789
4Y	-0,4931	0	-2	-0,4332	-0,2411	-0,0213
5Y	-0,4535	0	0	-0,3847	-0,1859	0,0347
7Y	-0,3602	0	2	-0,2807	-0,0745	0,1271
10Y	-0,2061	0	5	-0,1226	0,0637	0,2243
15Y	0,0020	1	7	0,0627	0,1844	0,2805
20Y	0,0990	1	9	0,1346	0,2053	0,2557
30Y	0,0973	1	12	0,1093	0,1392	0,1563

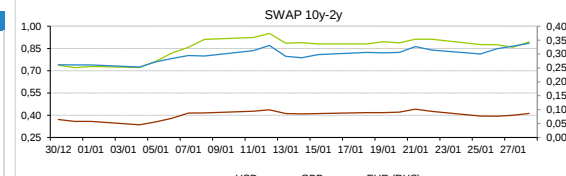
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,1835	0	-1	0,2129	0,7250	1,3495
2Y	0,1965	0	-1	0,2940	0,9149	1,4680
3Y	0,2644	1	1	0,4553	0,9995	1,5145
4Y	0,3859	2	4	0,5915	1,1670	1,6310
5Y	0,5223	2	6	0,7205	1,2365	1,6940
7Y	0,7926	3	11	0,9620	1,4060	1,6950
10Y	1,0903	4	13	1,2515	1,6110	1,7940
15Y	1,3646	4	14	1,4580	1,6815	1,8205
20Y	1,4879	3	14	1,5140	1,7454	1,8120
30Y	1,5676	3	13	1,5465	1,6455	1,7090

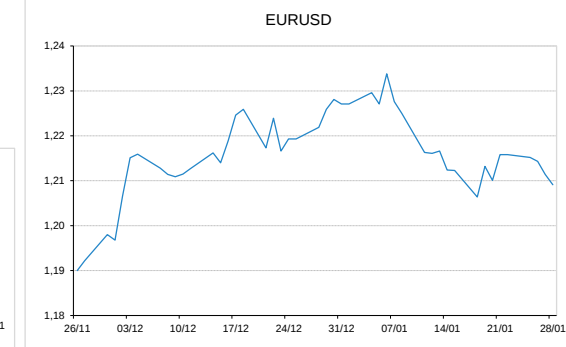
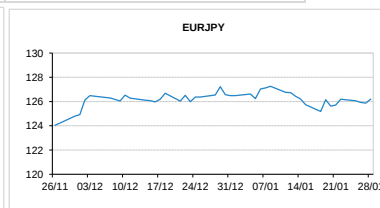
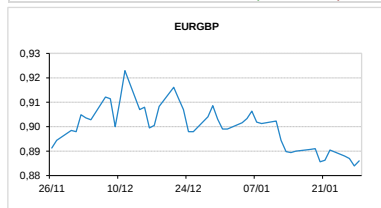


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	55,67	-0,14	4,77	OT 2Y	-0,677	-0,01	5,30
JETFUEL	465,22	0,97	24,72	OT 5Y	-0,458	-0,01	-1,30
DIESEL	454,50	0,50	28,00	OT 10Y	0,017	0,00	-1,60
COBRE	7.843,00	-183,50	37,50	BUND 10Y	-1,244	0,86	0,30
ZINCO	2.565,50	-74,00	-269,00	SCHATZ 2Y	-0,160	-0,46	-3,20
OURO	1.853,81	8,19	-22,82	T-NOTE 10Y	1,895	2,71	6,30
TRIGO	654,00	-4,25	39,75	T-NOTE 2Y	0,713	0,55	-0,20
LICENÇA C02	33,86	0,58	0,42	GILT 10Y	0,468	1,90	7,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2091	-0,19%	-1,05%	1,2116	1,2140	1,2195
EUR/GBP	0,88603	-0,23%	2,04%	0,8874	0,8887	0,8915
EUR/JPY	126,2	-0,26%	0,27%	126,20	126,20	126,20
EUR/CHF	1,0770	-0,08%	0,88%	1,0763	1,0757	1,0744
EUR/BRL	6,571	-0,31%	-2,49%	6,6053	6,6535	6,8054
EUR/PLN	4,5416	0,14%	-1,06%	4,5458	4,5513	4,5663



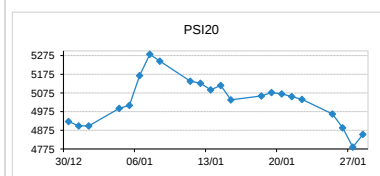
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2091	0,8860	126,20	1,0770	10,1005	7,4366	1,5530	1,5806	6,5710	10,4364
USD	0,8248	-	0,7288	104,31	0,8885	8,3423	6,1342	1,2806	1,3037	5,4309	8,6208

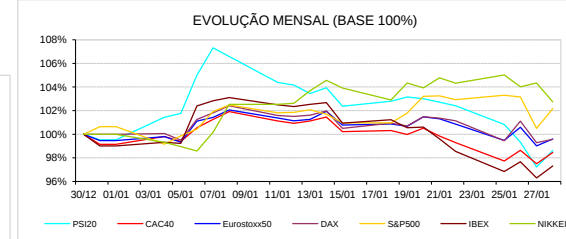
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,035	2,17	-2,42
BCP	0,118	4,16	-4,38
CORT. AMORIM	10,920	2,44	-5,86
CTT	2,405	3,22	2,34
EDP	5,210	2,24	1,05
EDP R	22,800	2,93	0,00
GALP	8,488	-1,05	-3,04
IBERSOL	4,910	-0,61	-9,07
J MARTINS	13,700	-0,90	-0,87
MOTA ENGIL	1,384	0,00	1,47
NAVIGATOR	2,500	2,21	0,08
NOVABASE	3,350	2,13	4,36
NOS	2,822	-0,42	-1,26
PHAROL	0,125	0,97	0,16
REN	2,355	-0,21	-0,42
SEMAPA	8,950	1,47	-0,56
SONAE SGPS	0,677	-0,07	2,34

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	4,16
CTT	3,22
EDP R	2,93
CORT. AMORIM	2,44
EDP	2,24
REN	-0,21
NOS	-0,42
IBERSOL	-0,61
J MARTINS	-0,90
GALP	-1,05



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.853,65	1,43%	-0,91%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.512,49	0,97%	-0,70%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.557,37	0,59%	0,13%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.659,65	0,29%	-0,43%	14.131,52	8.255,65
S&P 500	3.812,76	1,66%	1,52%	3.870,90	2.191,86
IBEX 35	7.934,70	1,04%	-1,72%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	28.197,42	-1,53%	2,74%	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.