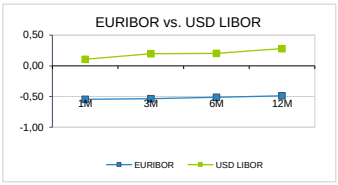
AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

RENDA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES

EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5450	1	0	1M	0,1073	0	-1	0,0488	-0,7984
3M	-0,5360	0	-1	3M	0,1990	1	1	0,0881	-0,7522
6M	-0,5130	0	0	6M	0,2033	0	0	0,1076	-0,7096
12M	-0,4880	0	-1	12M	0,2808	0	0	0,1606	-0,5962

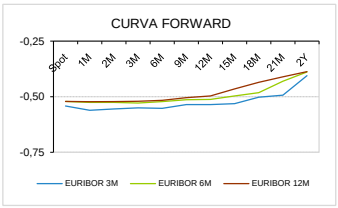


INTEREST RATE SWAPS

EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5211	0	-2	-0,4980	-0,2302	0,1236
2Y	-0,5085	0	-2	-0,4428	-0,1446	0,2030
3Y	-0,4683	1	-2	-0,3713	-0,0549	0,2795
4Y	-0,4080	1	0	-0,2933	0,0285	0,3540
5Y	-0,3380	1	1	-0,2098	0,1090	0,4250
7Y	-0,1820	2	4	-0,0471	0,2605	0,5350
10Y	0,0440	2	7	0,1715	0,4340	0,6505
15Y	0,3190	2	11	0,4096	0,5822	0,7115
20Y	0,4441	2	13	0,5023	0,6116	0,6885
30Y	0,4680	3	15	0,4967	0,5528	0,5884

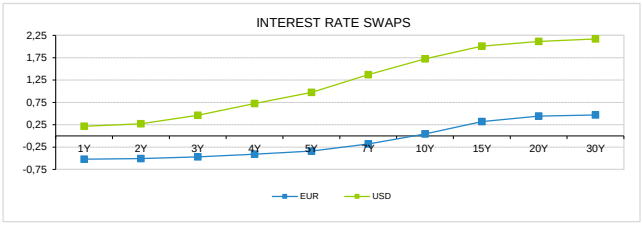
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL

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

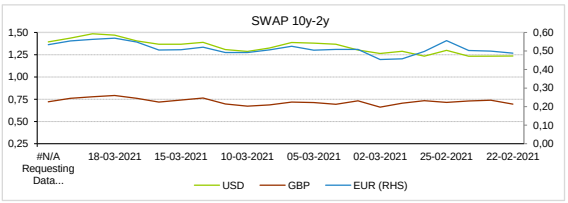


INTEREST RATE SWAPS FORWARDS

USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2151	0	3	0,3319	1,4875	2,2985
2Y	0,2699	1	4	0,5665	1,7450	2,4266
3Y	0,4600	1	6	0,8810	1,9490	2,4490
4Y	0,7242	1	10	1,1251	2,0590	2,5162
5Y	0,9744	1	14	1,3630	2,1560	2,5488
7Y	1,3708	1	19	1,6780	2,2180	2,5435
10Y	1,7228	1	20	1,9760	2,4072	2,5230
15Y	2,0074	2	21	2,1153	2,4440	2,5535
20Y	2,1149	2	21	2,2025	2,4522	2,4960
30Y	2,1690	2	21	2,1800	2,3535	2,3610

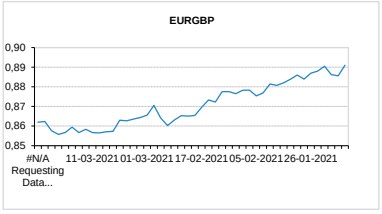


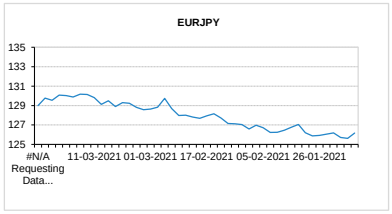
COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,60	0,03	0,18	OT 2Y	-0,592	0,02	-8,70
JETFUEL	527,76	21,76	-14,74	OT 5Y	-0,308	0,02	-11,40
DIESEL	513,75	21,25	-15,75	OT 10Y	0,198	0,02	-8,00
COBRE	8.950,00	182,50	-115,00	BUND 10Y	-0,839	3,17	-4,40
ZINCO	2.818,75	59,50	32,75	SCHATZ 2Y	-0,064	0,69	-2,00
OURO	1.711,85	-20,67	-22,19	T-NOTE 10Y	2,429	2,25	23,70
TRIGO	612,50	-0,75	-47,75	T-NOTE 2Y	0,754	0,74	4,00
LICENÇA C02	41,88	0,15	4,60	GILT 10Y	1,035	3,56	7,00

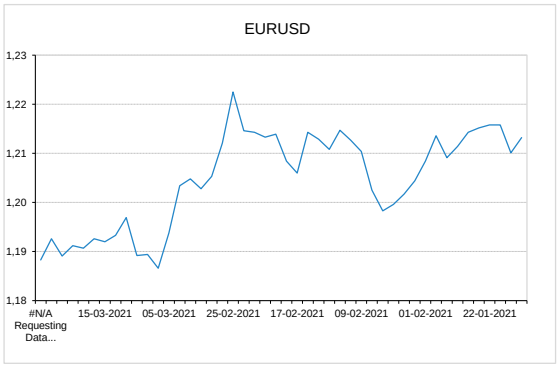


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1784	0,02%	-2,23%	1,1807	1,1831	1,1886
EUR/GBP	0,8512	0,45%	1,69%	0,8526	0,8541	0,8574
EUR/JPY	129,19	0,12%	-0,43%	129,19	129,19	129,19
EUR/CHF	1,1048	0,24%	-0,31%	1,1042	1,1035	1,1024
EUR/BRL	6,809	-0,32%	-0,38%	6,8635	6,9476	7,1644
EUR/PLN	4,6678	-0,57%	-2,88%	4,6745	4,6817	4,7015







FIXINGS CONTRA USD e EUR

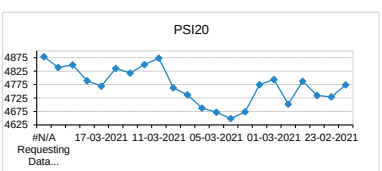
	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1784	0,8512	129,19	1,1048	10,2348	7,4366	1,4838	1,54113	6,8090	10,0463
USD	0,8500	-	0,7261	109,76	0,9389	8,7066	6,3213	1,2614	1,3108	5,8021	8,5600

ACCIONISTA

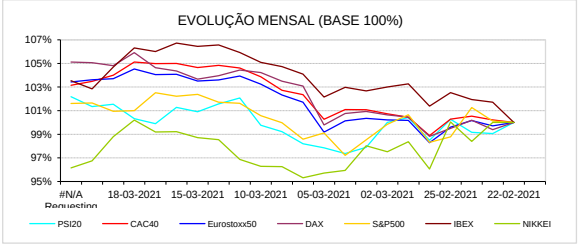
TITULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,845	-0,76	13,28
BCP	0,116	-0,34	-5,93
CORT. AMORIM	10,120	-0,20	-12,76
CTT	3,360	2,13	42,98
EDP	4,860	0,21	-5,74
EDP R	17,400	1,16	-23,68
GALP	10,050	0,00	14,80
IBERSOL	5,180	1,17	-4,07
J MARTINS	13,865	2,32	0,33
MOTA ENGIL	1,402	-0,57	2,79
NAVIGATOR	2,736	0,22	9,53
NOVABASE	3,750	2,74	16,82
NOS	3,148	1,35	10,15
PHAROL	0,119	1,54	-4,81
REN	2,375	0,42	0,42
SEMAPA	11,760	0,00	30,67
SONAE SGPS	0,783	-0,57	18,37
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

MAIORES GANHOS/PERDAS

Título	Variação %
NOVABASE	2,74
J MARTINS	2,32
CTT	2,13
PHAROL	1,54
NOS	1,35
CORT. AMORIM	-0,20
BCP	-0,34
MOTA ENGIL	-0,57
SONAE SGPS	-0,57
ALTRI	-0,76



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.864,35	0,57%	-0,69%	5.317,89	3.820,68
CAC40	6.015,51	0,45%	8,36%	6.089,20	4.142,28
ESTX 50 PR	3.882,87	0,42%	9,30%	3.890,20	2.626,10
XTRA DAX	14.817,72	0,47%	8,01%	14.845,42	9.337,02
S&P 500	3.956,85	-0,46%	5,33%	3.983,87	2.447,49
IBEX 35	8.492,10	-0,07%	5,18%	8.740,10	6.329,50
NIKKEI 225	29.384,52	0,71%	7,07%	30.714,52	17.646,50



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.