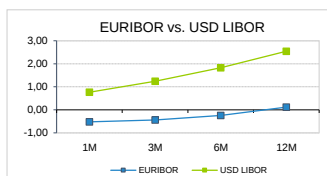


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

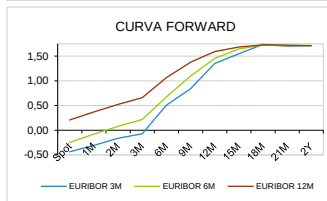
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP	CHF
1M	-0,5220	0	1	1M	0,7637	2	32	0,9017	-0,6750
3M	-0,4380	1	4	3M	1,2389	0	26	1,0903	-0,5325
6M	-0,2420	1	15	6M	1,8263	0	38	1,3832	-0,4850
12M	0,1180	1	25	12M	2,5441	0	46	1,8016	-0,7000

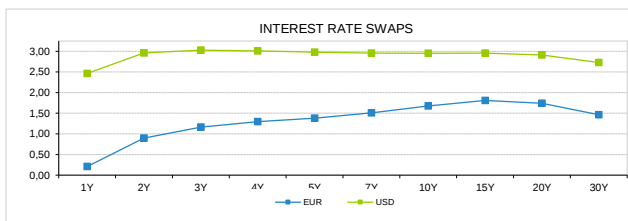


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2081	6	31	1,6010	1,7175	1,7940
2Y	0,8990	10	41	1,6480	1,7230	1,8470
3Y	1,1628	11	40	1,6720	1,7480	1,8960
4Y	1,2980	11	40	1,6850	1,7840	1,9480
5Y	1,3819	11	41	1,7050	1,8255	1,9985
7Y	1,5085	11	44	1,7728	1,9170	2,0550
10Y	1,6765	11	47	1,8848	1,9920	2,0540
15Y	1,8100	10	51	1,9320	1,9330	1,8860
20Y	1,7420	10	50	1,8050	1,7520	1,6690
30Y	1,4640	9	46	1,4970	1,4370	1,3665

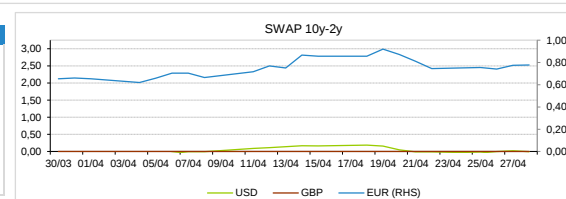
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,00
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	11,75
Austrália	0,10
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2.4651	7	47	3.3967	2.9190	2.8415
2Y	2.9616	8	37	3.2669	2.8690	2.9037
3Y	3.0296	7	31	3.1490	2.8580	2.9083
4Y	3.0110	7	32	3.0710	2.8645	2.9114
5Y	2.9802	7	34	3.0190	2.8755	2.9261
7Y	2.9588	6	37	3.0040	2.8905	2.9130
10Y	2.9541	5	41	2.9890	2.9235	2.9035
15Y	2.9564	4	43	2.9600	2.8999	2.8535
20Y	2.9133	3	41	2.9127	2.8207	2.7460
30Y	2.7302	2	36	2.6950	2.6091	2.5446

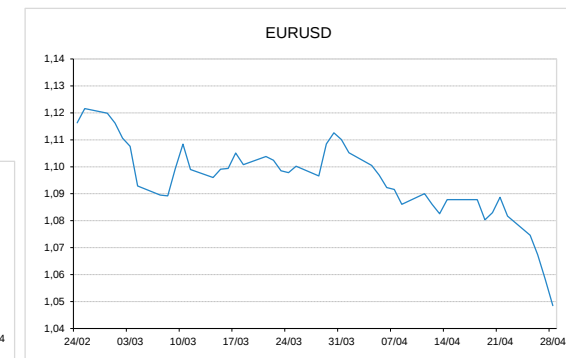
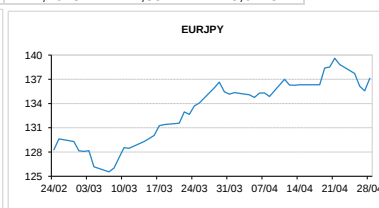
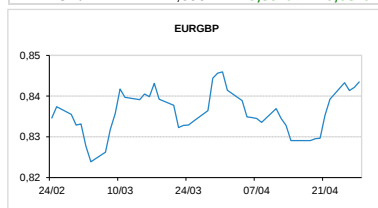


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	106.75	1,43	-2,74	OT 2Y	0.351	0,05	45,30
JETFUEL	1.281,92	23,92	26,67	OT 5Y	1.246	0,11	63,80
DIESEL	1.199,00	9,00	-31,25	OT 10Y	1.946	0,10	55,30
COBRE	9.855,00	-4,00	-411,00	BUND 10Y	0.439	9,16	23,90
ZINCO	4.258,00	40,50	178,00	SCHATZ 2Y	0.784	7,74	17,30
OURO	1.888,54	2,44	-34,26	T-NOTE 10Y	3.663	4,04	31,00
TRIGO	1.093,50	2,25	42,00	T-NOTE 2Y	3.145	6,67	17,00
LICENCA C02	82.92	1,91	2,11	GILT 10Y	1.919	5,68	20,50



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0485	-0,93%	-4,39%	1,0535	1,0602	1,0749
EUR/GBP	0,8435	-0,16%	-0,84%	0,8472	0,8516	0,8601
EUR/JPY	137,11	-1,14%	-0,88%	137,13	137,13	137,13
EUR/CHF	1,0211	0,20%	0,54%	1,0207	1,0199	1,0184
EUR/BRL	5,2529	-0,15%	-0,36%	5,4269	5,6000	5,9223
EUR/PI N	4,6904	0,39%	0,08%	4,7678	4,8571	5,0248

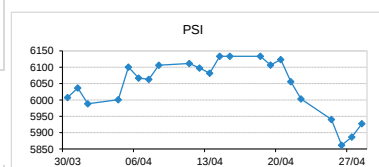


FIXINGS CONTRA USD e EUR											
	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0485	0,8435	137,13	1,0211	10,3478	7,4423	1,3493	1,48405	5,2529	9,8932
USD	0,9510	-	0,8039	131,005	0,9716	9,8341	7,0771	1,2842	1,4131	5,0262	9,4035

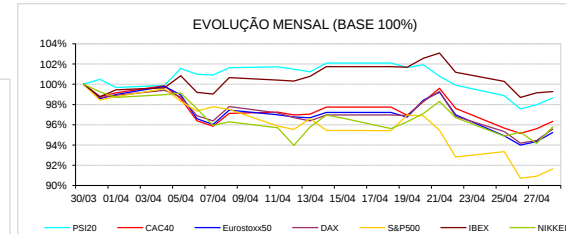
ACCIONISTA

TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,215	-0,72	10,78
BCP	0,148	0,95	5,32
CORT. AMORIM	9,820	1,97	-12,94
CTT	4,255	1,31	-6,59
EDP	4,467	0,38	-7,55
EDP R	22,860	0,31	4,38
GALP	11,175	1,92	31,16
J MARTINS	20,600	0,10	2,49
MOTA ENGIL	1,266	-0,47	-0,78
NAVIGATOR	3,868	0,05	15,46
NOS	4,038	-0,05	18,42
REN	2,930	0,69	15,13
SEMAPA	13,100	0,31	11,97
SONAE SGPS	1,018	1,90	1,50
GREENVOIT	6,840	0,15	7,72

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORII	1,97
GALP	1,92
SONAE SGPS	1,90
CTT	1,31
BCP	0,95
NOS	-0,05
MOTA ENIGIL	-0,47
ALTRI	-0,72



INDEX	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Annual	MIN Annual
PSI	5.927,50	0,70%	6,43%	6.153,32	4.859,53
CAC40	6.948,87	0,77%	-9,20%	7.384,86	5.756,38
ESTX 50 PR	3.770,41	0,96%	-12,28%	4.415,23	3.387,00
XTRA DAX	13.960,09	1,20%	-12,12%	16.290,19	12.438,85
S&P 500	4.218,26	0,82%	-11,50%	4.818,62	4.056,88
IBEX 35	8.488,80	0,73%	-2,58%	9.310,80	7.287,70
NIKKEI 225	26.847,90	1,15%	-6,75%	30.795,78	24.681,74



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