

**AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS**

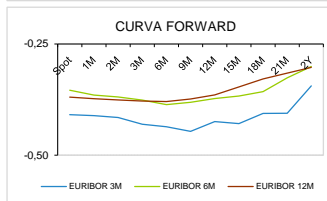
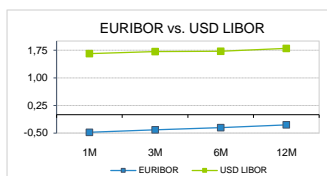
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENDA FIXA**

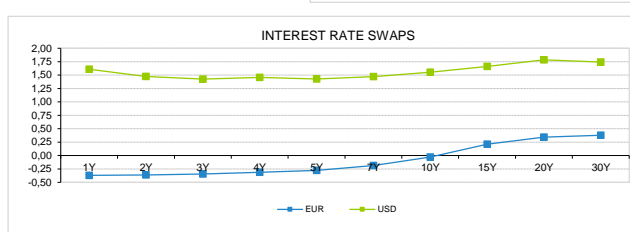
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4770	-1	-1	1M	1,6579	-1	-2	0,7034	-0,7700
3M	-0,4090	-1	-1	3M	1,7131	-2	-12	0,7539	-0,6890
6M	-0,3500	0	-2	6M	1,7206	-2	-15	0,8160	-0,6364
12M	-0,2760	-1	-2	12M	1,8005	-3	-17	0,8793	-0,4924

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3700	-1	-5	-0,3658	-0,2232	-0,0305
2Y	-0,3620	0	-6	-0,3334	-0,1792	0,0305
3Y	-0,3440	-1	-9	-0,2962	-0,1310	0,0956
4Y	-0,3130	-1	-11	-0,2565	-0,0745	0,1587
5Y	-0,2760	-1	-13	-0,2110	-0,0145	0,2180
7Y	-0,1880	-1	-17	-0,1047	0,1070	0,3317
10Y	-0,0290	-2	-19	0,0650	0,2753	0,4610
15Y	0,2110	-2	-21	0,2906	0,4359	0,5580
20Y	0,3420	-2	-21	0,3948	0,4866	0,5590
30Y	0,3780	-2	-22	0,4043	0,4445	0,4731

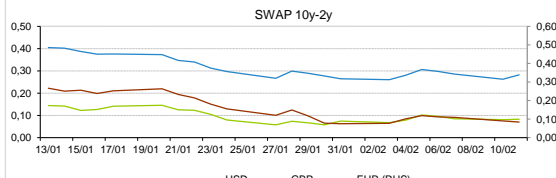
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,75
Índia	4,00



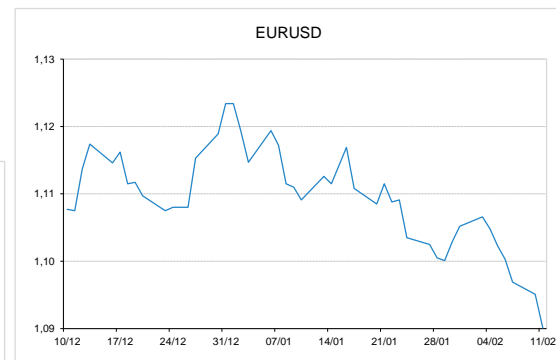
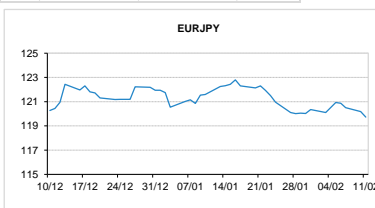
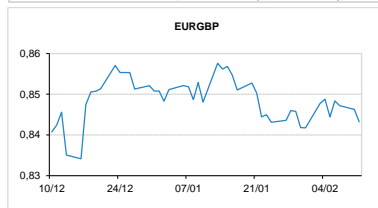
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,6080	-3	-11	1,3186	1,3645	1,5050
2Y	1,4730	-4	-14	1,2940	1,3860	1,5569
3Y	1,4250	-5	-16	1,3289	1,4240	1,5750
4Y	1,4570	3	-19	1,3578	1,4798	1,6100
5Y	1,4280	-5	-17	1,3720	1,5155	1,6631
7Y	1,4710	-6	-18	1,4554	1,5852	1,6970
10Y	1,5530	-6	-20	1,5355	1,6678	1,7470
15Y	1,6610	-6	-20	1,6390	1,7210	1,7890
20Y	1,7840	6	-12	1,7065	1,7625	1,8102
30Y	1,7430	-6	-20	1,7170	1,7396	1,7551



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	54,18	0,91	-10,07	OT 2Y	-0,411	-0,01	7,30
JETFUEL	518,59	-9,64	-115,19	OT 5Y	-0,107	0,00	0,40
DIESEL	497,87	-9,59	-100,38	OT 10Y	0,310	0,02	-8,40
COBRE	5.659,00	4,00	-531,00	BUND 10Y	-1,018	1,96	-20,00
ZINCO	2.127,75	-14,75	-255,25	SCHATZ 2Y	-0,005	0,46	-4,20
OURO	1.566,14	-10,35	3,80	T-NOTE 10Y	2,478	3,16	-19,00
TRIGO	548,50	-3,50	-16,00	T-NOTE 2Y	1,904	3,43	-12,80
LICENÇA C02	23,35	0,19	-0,86	GILT 10Y	0,480	1,21	-22,40


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0901	-0,46%	-2,02%	1,0961	1,1020	1,1136
EUR/GBP	0,84325	0,36%	1,70%	0,8458	0,8484	0,8535
EUR/JPY	119,73	0,38%	2,10%	119,73	119,73	119,73
EUR/CHF	1,0657	0,08%	1,40%	1,0650	1,0642	1,0625
EUR/BRL	4,7304	-0,23%	-2,47%	4,7722	4,8152	4,9243
EUR/PLN	4,2569	0,34%	-0,51%	4,2779	4,3001	4,3482

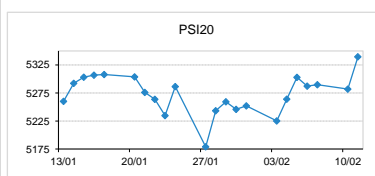

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0901	0,8433	119,73	1,0657	10,5160	7,4723	1,4519	1,62646	4,7304	10,0978
USD	0,9161	-	0,7725	109,905	0,9772	9,6339	6,8454	1,3289	1,4878	4,3179	9,2466

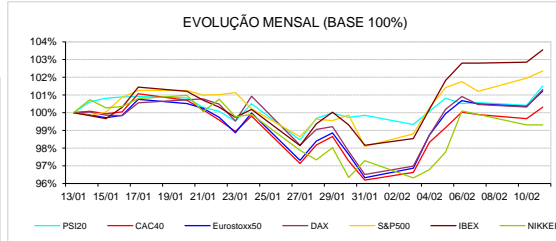
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	5,755	0,35	1,32
BCP	0,192	1,86	-5,57
CORT. AMORIM	10,780	2,28	-4,60
CTT	2,914	0,76	-8,65
EDP	4,703	1,23	21,71
EDP R	12,380	0,49	17,90
GALP	13,705	1,07	-8,02
IBERSOL	8,760	-2,67	9,50
J MARTINS	16,365	0,83	11,59
MOTA ENGIL	1,697	1,50	-9,25
NAVIGATOR	3,400	2,91	-1,41
NOS	4,466	0,54	-6,96
PHAROL	0,100	-0,10	0,00
RAMADA	5,580	-1,76	-4,45
REN	2,735	0,55	0,55
SEMAPA	12,760	2,24	-7,00
SONAE CAP.	0,762	-0,26	1,20
SONAE SGPS	0,842	1,08	-7,47

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NAVIGATOR	2,91
CORT. AMORIM	2,28
SEMAPA	2,24
BCP	1,86
MOTA ENGIL	1,50
PHAROL	-0,10
SONAE CAP.	-0,26
RAMADA	-1,76
IBERSOL	-2,67



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.339,48	1,09%	2,40%	5.429,32	4.699,20
CAC40	6.054,76	0,65%	1,28%	6.109,81	4.986,30
ESTX 50 PR	3.825,84	0,86%	2,15%	3.832,06	3.142,84
XTRA DAX	13.627,84	0,99%	2,86%	13.668,43	10.944,58
S&P 500	3.365,49	0,40%	4,17%	3.375,63	2.703,79
IBEX 35	9.882,60	0,68%	3,49%	9.884,00	8.409,20
NIKKEI 225	23.685,98	-0,60%	0,12%	24.115,95	20.110,76



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.