

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

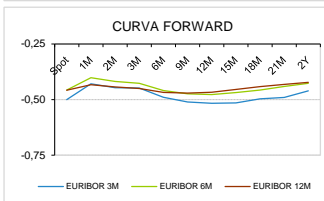
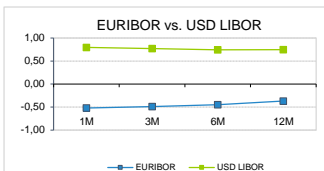
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENDA FIXA**

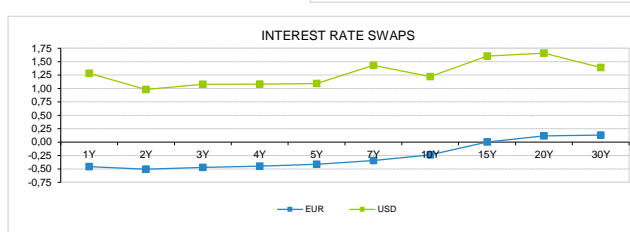
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5200	-2	-5	1M	0,7966	-1	-86	0,2609	-0,9090
3M	-0,4890	-2	-8	3M	0,7725	-1	-93	0,3828	-0,8466
6M	-0,4470	-2	-9	6M	0,7440	-3	-98	0,4384	-0,7958
12M	-0,3680	-3	-8	12M	0,7465	-5	-106	0,5175	-0,6800

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4584	3	-8	-0,4695	-0,3200	-0,2702
2Y	-0,5050	-3	-15	-0,4617	-0,2690	-0,2148
3Y	-0,4710	0	-14	-0,4012	-0,2496	-0,1758
4Y	-0,4480	0	-15	-0,3549	-0,2363	-0,1448
5Y	-0,4120	-1	-14	-0,3338	-0,2087	-0,1015
7Y	-0,3430	1	-18	-0,2778	-0,1627	-0,0681
10Y	-0,2380	-1	-21	-0,1968	-0,0805	0,0005
15Y	0,0030	2	-24	-0,0986	-0,0563	-0,0518
20Y	0,1160	2	-26	-0,1243	-0,1159	-0,1343
30Y	0,1310	3	-28	-0,2687	-0,2776	-0,2997

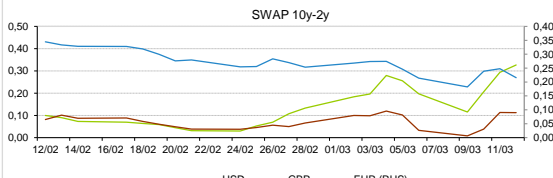
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,25
Reino Unido	0,25
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,50
Índia	4,00



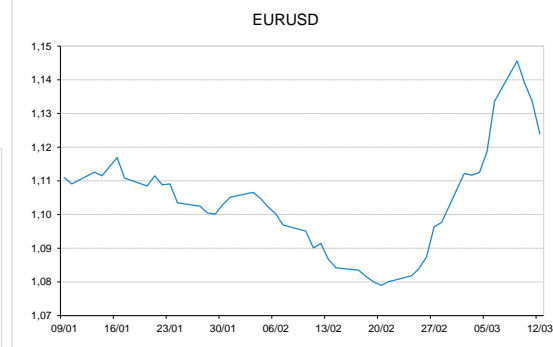
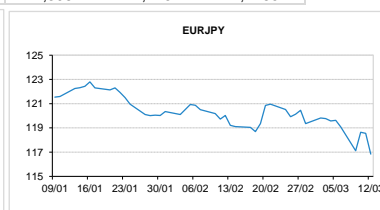
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,2810	-22	-36	0,3952	0,7025	0,8640
2Y	0,9820	-14	-54	0,4721	0,7440	0,8610
3Y	1,0790	-22	-57	0,5524	0,8010	0,8655
4Y	1,0800	-31	-35	0,6214	0,8158	0,8740
5Y	1,0930	-19	-34	0,6680	0,8345	0,9330
7Y	1,4310	-7	-31	0,7219	0,8455	0,8595
10Y	1,2200	-16	-62	0,7850	0,8265	0,8322
15Y	1,6050	-9	-35	0,7721	0,8190	0,8253
20Y	1,6590	-13	-35	0,7771	0,8100	0,8060
30Y	1,3910	-14	-65	0,7503	0,7580	0,7428



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	32,68	-3,11	-23,23	OT 2Y	-0,104	0,17	30,10
JETFUEL	340,96	-87,21	-195,90	OT 5Y	0,335	0,27	43,40
DIESEL	340,25	-36,52	-173,00	OT 10Y	0,726	0,31	41,60
COBRE	5.508,00	-37,00	-216,00	BUND 10Y	-1,184	0,13	-35,10
ZINCO	1.977,00	14,25	-168,00	SCHATZ 2Y	-0,333	-0,45	-32,40
OURO	1.583,87	-59,71	15,61	T-NOTE 10Y	1,823	-5,83	-66,80
TRIGO	504,00	-8,75	-44,50	T-NOTE 2Y	0,841	-7,24	-97,60
LICENÇA C02	22,73	-1,19	-1,15	GILT 10Y	0,227	-0,93	-32,10


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,124	-0,85%	2,99%	1,1288	1,1321	1,1382
EUR/GBP	0,88623	-1,05%	-5,15%	0,8886	0,8909	0,8955
EUR/JPY	116,84	1,46%	2,73%	116,84	116,84	116,84
EUR/CHF	1,0561	0,36%	0,74%	1,0551	1,0543	1,0524
EUR/BRL	5,3714	1,08%	-11,90%	5,4262	5,4759	5,6355
EUR/PLN	4,3762	-1,30%	-2,83%	4,3987	4,4164	4,4485


**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

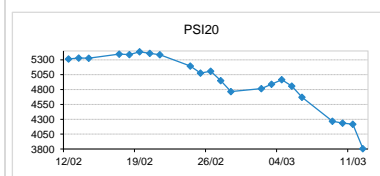
	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1240	0,8862	116,84	1,0561	10,8471	7,4730	1,5337	1,7564	5,3714	11,3316
USD	0,8971	-	0,7919	105,005	0,9470	9,7805	6,7044	1,3802	1,5789	4,8761	10,1127

**ACCIONISTA**

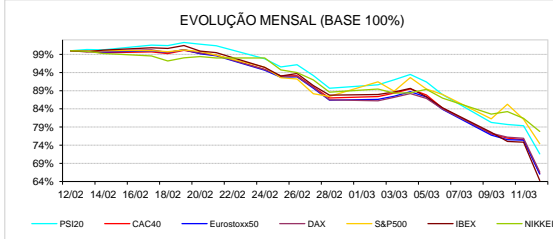
TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,440	-13,65	-39,44
BCP	0,113	-9,23	-44,23
CORT. AMORIM	8,360	-5,75	-26,02
CTT	1,901	-10,33	-40,41
EDP	3,475	-13,84	-10,07
EDP R	10,060	-11,60	-4,19
GALP	8,450	-10,09	-43,29
IBERSOL	6,280	-8,99	-21,50
J MARTINS	13,865	-6,19	-5,46
MOTA ENGIL	1,057	-3,82	-43,48
NAVIGATOR	2,106	-10,38	-38,93
NOS	2,866	-7,55	-40,29
PHAROL	0,072	-3,49	-27,71
RAMADA	3,520	-18,52	-39,73
REN	2,190	-9,50	-19,49
SEMAPA	9,270	-9,47	-32,43
SONAE CAP.	0,520	-11,71	-30,94
SONAE SGPS	0,587	-7,92	-35,49

**MAIORES GANHOS/PERDAS**

Título	Variação %
EDP R	-11,60
SONAE CAP.	-11,71
ALTRI	-13,65
EDP	-13,84
RAMADA	-18,52



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	3.805,92	-9,76%	-27,01%	5.454,21	3.784,30
CAC40	4.044,26	-12,28%	-32,35%	6.111,41	4.025,89
ESTX 50 PR	2.545,23	-12,40%	-32,04%	3.867,28	2.535,89
XTRA DAX	9.161,13	-12,24%	-30,85%	13.795,24	9.139,12
S&P 500	2.513,35	-8,24%	-22,14%	3.393,52	2.500,65
IBEX 35	6.390,90	-14,06%	-33,07%	10.100,20	6.347,00
NIKKEI 225	18.559,63	-4,41%	-21,55%	24.115,95	18.339,27



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.