

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

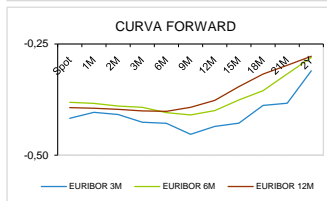
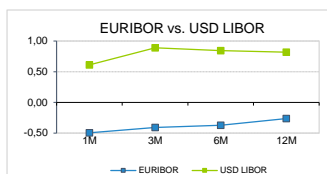
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENDA FIXA**

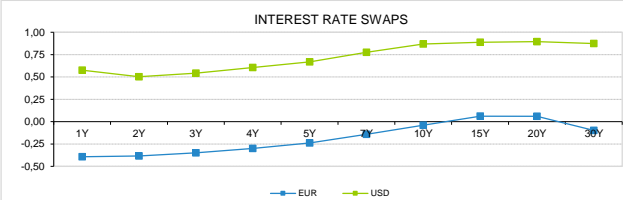
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4950	-1	-2	1M	0,6116	-19	-105	0,2534	-0,8566
3M	-0,4080	0	1	3M	0,8894	5	-80	0,4868	-0,7870
6M	-0,3730	0	-2	6M	0,8438	2	-87	0,6046	-0,7442
12M	-0,2630	1	3	12M	0,8194	0	-98	0,7078	-0,6330

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,3925	0	-1	-0,3774	-0,1566	0,0639	
2Y	-0,3844	1	0	-0,3337	-0,0835	0,0892	
3Y	-0,3495	1	1	-0,2744	-0,0331	0,1112	
4Y	-0,2990	1	4	-0,2083	0,0005	0,1300	
5Y	-0,2390	2	6	-0,1558	0,0313	0,1476	
7Y	-0,1425	3	7	-0,0729	0,0810	0,1761	
10Y	-0,0403	3	1	0,0130	0,1319	0,2030	
15Y	0,0608	2	-13	0,0852	0,1384	0,1502	
20Y	0,0605	1	-26	0,0592	0,0641	0,0405	
30Y	-0,0976	1	-45	-0,1107	-0,1197	-0,1413	

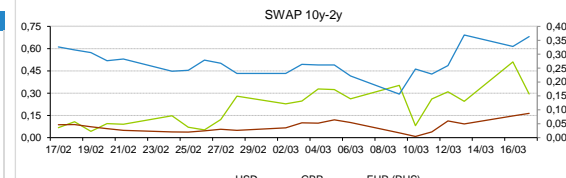
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,25
Japão	0,10
Canadá	0,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,50
Índia	4,00



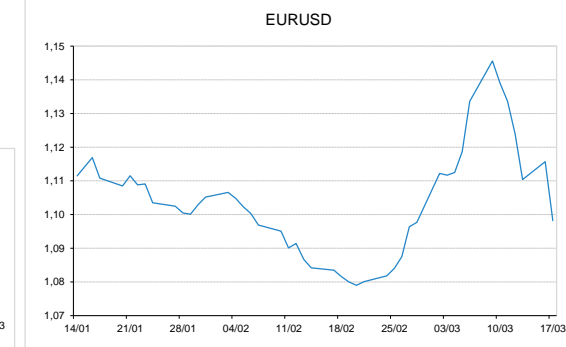
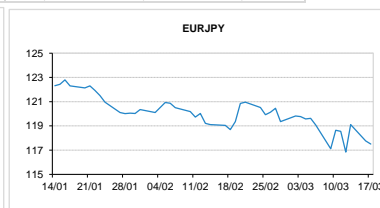
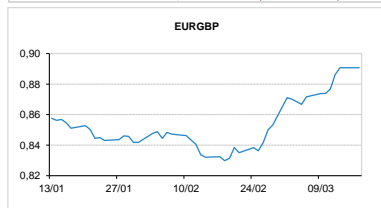
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS			
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	0,5751	8	-101	0,4178	0,7710	0,9972	
2Y	0,5025	5	-96	0,5135	0,8450	1,0240	
3Y	0,5419	4	-88	0,6025	0,8978	1,0390	
4Y	0,6058	4	-80	0,6790	0,9320	1,0505	
5Y	0,6690	4	-75	0,7412	0,9605	1,0718	
7Y	0,7760	7	-68	0,8325	0,9940	1,0128	
10Y	0,8680	9	-67	0,8950	0,9663	0,9806	
15Y	0,8870	9	-75	0,8919	0,9498	0,9625	
20Y	0,8951	9	-80	0,8973	0,9331	0,9325	
30Y	0,8738	9	-84	0,8617	0,8732	0,8551	



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	29,73	-0,32	-27,76	OT 2Y	0,140	0,12	43,50
JETFUEL	295,27	-47,65	-243,96	OT 5Y	0,781	0,15	69,30
DIESEL	313,23	-32,77	-206,61	OT 10Y	1,278	0,22	98,70
COBRE	5.285,00	-169,50	-469,50	BUND 10Y	-0,833	4,13	1,10
ZINCO	1.933,50	-43,00	-211,50	SCHATZ 2Y	-0,206	5,47	-17,60
OURO	1.527,79	35,45	-53,39	T-NOTE 10Y	1,947	11,84	-66,70
TRIGO	505,50	7,50	-36,00	T-NOTE 2Y	0,971	8,92	-86,10
LICENÇA C02	18,38	-1,09	-6,67	GILT 10Y	0,525	10,48	-30,00


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0982	-1,57%	1,36%	1,1033	1,1062	1,1121
EUR/GBP	0,90823	0,10%	-8,35%	0,9103	0,9125	0,9172
EUR/JPY	117,5	0,22%	1,32%	117,50	117,50	117,50
EUR/CHF	1,0572	-0,04%	0,54%	1,0551	1,0536	1,0511
EUR/BRL	5,5245	1,22%	-15,14%	5,5664	5,5989	5,6939
EUR/PLN	4,4740	-0,68%	-4,74%	4,4903	4,5018	4,5228

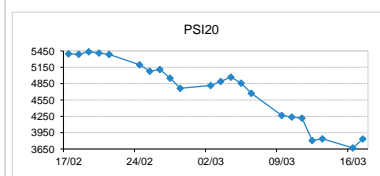

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0982	0,9082	117,50	1,0572	10,8938	7,4733	1,5596	1,83622	5,5245	11,5000
USD	0,9117	-	0,8301	107,3	0,9618	9,9057	6,8128	1,4150	1,6699	5,0476	10,4861

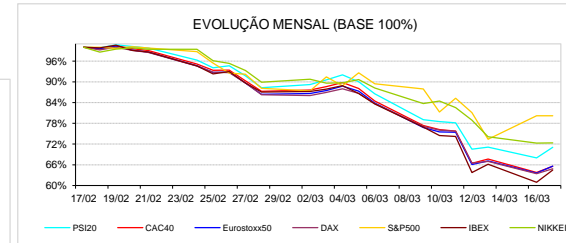
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	3,204	-1,17	-43,59
BCP	0,105	3,45	-48,22
CORT. AMORIM	7,600	-2,94	-32,74
CTT	2,060	11,59	-35,42
EDP	3,620	6,66	-6,31
EDP R	10,160	2,94	-3,24
GALP	8,828	6,85	-40,75
IBERSOL	4,660	-2,71	-41,75
J MARTINS	15,470	8,14	5,49
MOTA ENGIL	1,157	6,64	-38,13
NAVIGATOR	2,058	5,54	-40,32
NOS	2,834	1,43	-40,96
PHAROL	0,067	0,90	-32,33
RAMADA	3,000	-6,25	-48,63
REN	2,030	1,25	-25,37
SEMAPA	8,050	-1,11	-41,33
SONAE CAP.	0,449	-2,82	-40,44
SONAE SGPS	0,550	-0,09	-39,62

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	11,59
J MARTINS	8,14
GALP	6,85
EDP	6,66
MOTA ENGIL	6,64
ALTRI	-1,17
IBERSOL	-2,71
SONAE CAP.	-2,82
CORT. AMORIM	-2,94
RAMADA	-6,25



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	3.834,87	4,49%	-26,45%	5.454,21	3.547,01
CAC40	3.991,78	2,84%	-33,23%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.529,00	3,21%	-32,47%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	8.939,10	2,25%	-32,53%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.500,64	4,79%	-22,61%	3.393,52	2.367,04
IBEX 35	6.464,00	5,84%	-32,31%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	17.011,53	0,06%	-28,09%	24.115,95	16.378,94



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.