

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

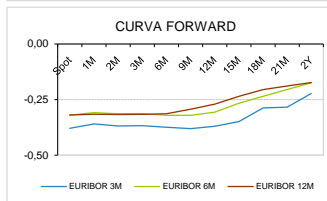
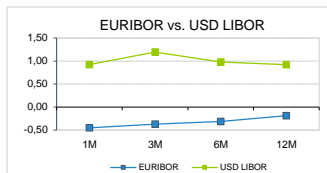
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

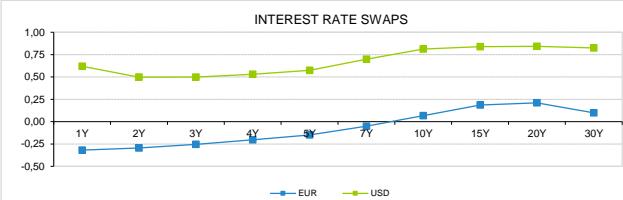
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4500	2	3	1M	0,9236	15	-72	0,2878	-0,8506
3M	-0,3710	2	4	3M	1,1951	8	-50	0,5804	-0,7672
6M	-0,3130	3	5	6M	0,9795	3	-72	0,6899	-0,7008
12M	-0,1860	4	11	12M	0,9220	3	-85	0,7545	-0,5796

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3185	1	6	-0,2786	-0,0699	0,1563
2Y	-0,2943	-1	8	-0,2267	0,0007	0,1915
3Y	-0,2539	-3	11	-0,1742	0,0527	0,2150
4Y	-0,2037	-5	14	-0,1127	0,0965	0,2390
5Y	-0,1483	-6	17	-0,0588	0,1305	0,2640
7Y	-0,0505	-8	19	0,0292	0,1865	0,3065
10Y	0,0668	-9	17	0,1253	0,2601	0,3515
15Y	0,1863	-6	7	0,2258	0,2961	0,3270
20Y	0,2102	-4	-2	0,2241	0,2461	0,2396
30Y	0,0990	-3	-16	0,0959	0,0949	0,0787

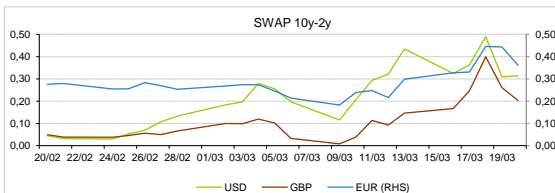
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,75
Austrália	0,25
Índia	4,00



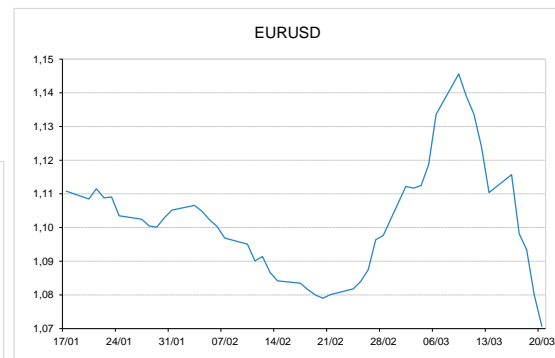
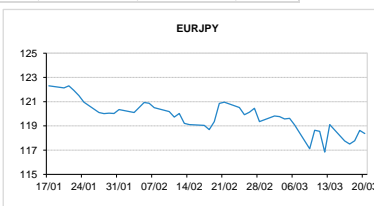
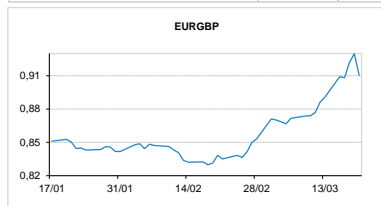
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,6188	-9	-93	0,4582	0,4740	0,9820
2Y	0,4977	-10	-91	0,4332	0,6665	1,0303
3Y	0,4985	-10	-87	0,4470	0,7757	1,0608
4Y	0,5305	-10	-82	0,5516	0,8490	1,0524
5Y	0,5736	-9	-78	0,6362	0,8970	1,0645
7Y	0,6982	-9	-69	0,7539	0,9365	1,0005
10Y	0,8116	-10	-65	0,8320	0,9170	0,9590
15Y	0,8385	-10	-71	0,8390	0,9020	1,1813
20Y	0,8422	-10	-76	1,0746	1,1510	0,8960
30Y	0,8251	-10	-79	1,0718	0,8274	0,8237



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	28,52	0,05	-30,28	OT 2Y	-0,023	-0,04	41,60
JETFUEL	262,46	17,45	-281,27	OT 5Y	0,465	-0,13	59,20
DIESEL	307,25	29,50	-216,00	OT 10Y	0,949	-0,14	67,50
COBRE	4.810,00	80,00	-945,00	BUND 10Y	-0,749	-16,92	11,00
ZINCO	1.839,00	5,75	-284,50	SCHATZ 2Y	-0,050	-3,44	-2,70
OURO	1.485,94	13,66	-130,86	T-NOTE 10Y	1,955	-12,56	-53,00
TRIGO	541,25	6,25	-18,00	T-NOTE 2Y	0,863	-5,20	-97,10
LICENÇA C02	16,15	-0,24	-9,49	GILT 10Y	0,516	-28,32	-6,80


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0707	-0,87%	-0,77%	1,0750	1,0779	1,0834
EUR/GBP	0,91028	2,15%	-7,90%	0,9124	0,9144	0,9183
EUR/JPY	118,37	0,22%	2,10%	118,37	118,37	118,37
EUR/CHF	1,0536	0,04%	0,78%	1,0527	1,0524	1,0508
EUR/BRL	5,3589	1,70%	-11,55%	5,4158	5,4457	5,5338
EUR/PLN	4,5198	1,09%	-5,27%	4,5391	4,5482	4,5633

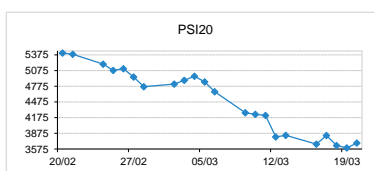

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0707	0,9103	118,37	1,0536	11,0447	7,4697	1,5320	1,83218	5,3589	12,6143
USD	0,9320	-	0,8421	110,86	0,9821	10,2597	6,9601	1,4281	1,7001	5,0189	11,4378

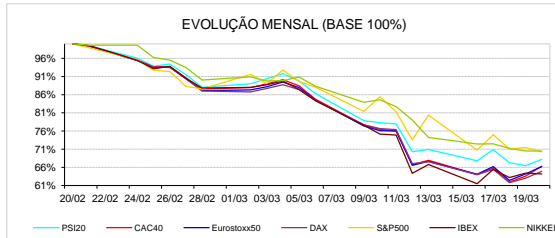
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,170	6,38	-44,19
BCP	0,102	1,99	-49,51
CORT. AMORIM	7,930	-0,75	-29,82
CTT	1,906	1,06	-40,25
EDP	3,283	7,11	-15,04
EDP R	9,370	3,31	-10,76
GALP	8,230	-3,18	-44,77
IBERSOL	4,570	-8,60	-42,88
J MARTINS	14,965	-0,23	2,05
MOTA ENGIL	1,076	-4,78	-42,46
NAVIGATOR	2,014	3,81	-41,60
NOS	3,074	7,94	-35,96
PHAROL	0,072	2,71	-27,81
RAMADA	2,800	-6,35	-52,05
REN	2,005	1,37	-26,29
SEMAPA	7,540	6,50	-45,04
SONAE CAP.	0,419	-2,78	-44,36
SONAE SGPS	0,543	7,10	-40,33

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOS	7,94
EDP	7,11
SONAE SGPS	7,10
SEMAPA	6,50
ALTRI	6,38
SONAE CAP.	-2,78
GALP	-3,18
MOTA ENGIL	-4,78
RAMADA	-6,35
IBERSOL	-8,60



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	3.689,88	2,61%	-29,23%	5.454,21	3.547,01
CAC40	4.022,27	4,33%	-32,72%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.531,42	3,15%	-32,41%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	8.870,25	3,02%	-33,05%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.377,96	-1,64%	-26,64%	3.393,52	2.280,52
IBEX 35	6.374,00	-0,34%	-33,25%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	16.552,83	-1,04%	-30,03%	24.115,95	16.358,19



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.