

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

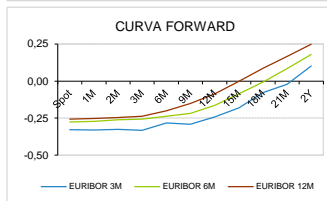
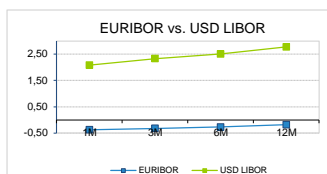
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

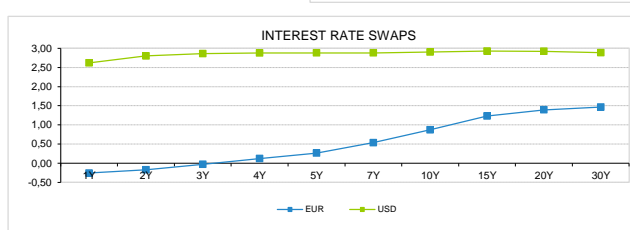
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	2,0863	-1	6	0,5276	-0,7738
3M	-0,3210	0	0	3M	2,3314	-1	1	0,7125	-0,7302
6M	-0,2700	0	0	6M	2,5081	-1	2	0,8330	-0,6470
12M	-0,1810	0	0	12M	2,7738	-1	3	0,9988	-0,5184

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2575	0	-2	-0,0880	0,5580	1,0980
2Y	-0,1710	-1	-4	0,0786	0,7010	1,2090
3Y	-0,0310	-1	-6	0,2380	0,8320	1,3145
4Y	0,1210	-1	-7	0,3880	0,9530	1,4100
5Y	0,2670	-2	-8	0,5280	1,0660	1,4910
7Y	0,5370	-2	-9	0,7795	1,2585	1,6225
10Y	0,8730	-2	-9	1,0790	1,4649	1,7430
15Y	1,2300	-2	-8	1,3704	1,6335	1,8115
20Y	1,3950	-1	-7	1,4924	1,6755	1,7903
30Y	1,4650	-1	-6	1,5268	1,6465	1,7175

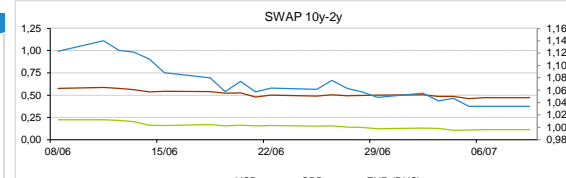
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



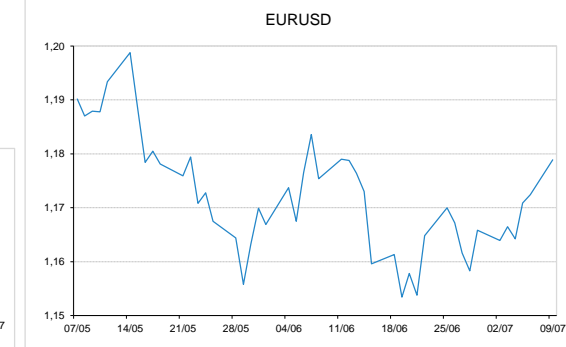
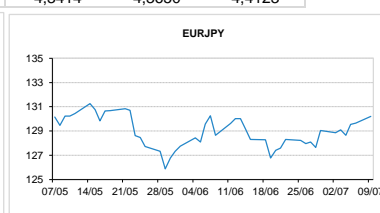
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6180	0	4	2,9988	2,9279	2,9075
2Y	2,8000	0	2	2,9966	2,8990	2,8910
3Y	2,8600	0	-1	2,9530	2,8940	2,9331
4Y	2,8760	0	-4	2,9370	2,8960	2,9471
5Y	2,8790	0	-6	2,9270	2,9000	2,9633
7Y	2,8810	0	-9	2,9220	2,9509	2,9520
10Y	2,9030	-1	-12	2,9460	2,9470	2,9640
15Y	2,9260	-1	-14	2,9570	2,9520	2,9751
20Y	2,9210	-1	-15	2,9420	2,9300	2,9260
30Y	2,8850	-1	-16	2,9030	2,8850	2,8730



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	78,00	0,89	1,81	OT 2Y	-0,073	0,02	-5,60
JETFUEL	716,22	-3,65	18,42	OT 5Y	0,618	-0,02	-23,50
DIESEL	669,72	-5,15	12,92	OT 10Y	1,782	-0,02	-24,90
COBRE	6.308,50	-63,00	-938,00	BUND 10Y	-0,194	1,55	-22,10
ZINCO	2.763,00	30,00	-436,50	SCHATZ 2Y	-0,021	0,92	-4,20
OURO	1.260,71	5,30	-37,45	T-NOTE 10Y	3,580	1,67	-6,40
TRIGO	508,25	-7,00	-28,50	T-NOTE 2Y	2,969	2,34	2,70
LICENÇA C02	16,02	0,32	0,20	GILT 10Y	1,489	0,29	-15,70


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1789	0,55%	-0,01%	1,1871	1,1963	1,2152
EUR/GBP	0,88345	0,28%	-0,19%	0,8860	0,8889	0,8952
EUR/JPY	130,21	-0,43%	-0,45%	130,21	130,21	130,21
EUR/CHF	1,1651	-0,22%	-0,27%	1,1639	1,1627	1,1605
EUR/BRL	4,5449	-0,19%	-3,76%	4,6192	4,6891	4,8450
EUR/PLN	4,3179	0,85%	-1,11%	4,3414	4,3650	4,4123


**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

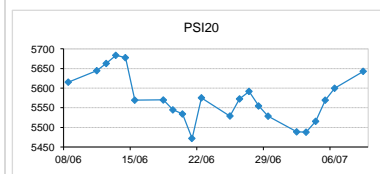
	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1789	0,8835	130,21	1,1651	10,2492	7,4535	1,5397	1,57312	4,5449	9,4147
USD	0,8505	-	0,7542	110,715	0,9906	8,7239	6,3394	1,3091	1,3392	3,8683	8,0094

**ACCIONISTA**

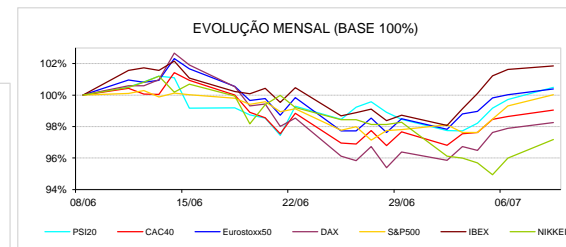
TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	8,730	1,04	68,83
BCP	0,259	0,70	-4,63
CORT. AMORIM	11,3800	1,79	10,49
CTT	2,9480	1,10	-15,94
EDP	3,492	1,81	21,04
EDP R	9,055	-0,49	29,97
GALP	17,190	1,63	12,17
IBERSOL	12,300	0,41	1,23
J MARTINS	12,585	0,12	-22,29
MOTA ENGIL	3,060	0,82	-16,46
NAVIGATOR	5,070	0,90	20,14
NOS	4,910	0,86	-10,42
NOVABASE	2,740	0,00	-10,13
PHAROL	0,245	2,08	-2,00
REN	2,474	0,16	-0,20
SEMAPA	23,000	-0,22	29,25
SONAE CAP.	0,935	0,54	5,41
SONAE SGPS	1,022	-0,10	-9,24

**MAIORES GANHOS/PERDAS**

Título	Variação %
PHAROL	2,08
EDP	1,81
CORT. AMORIM	1,79
GALP	1,63
CTT	1,10
SONAE SGPS	-0,10
SEMAPA	-0,22
EDP R	-0,49



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.642,86	0,77%	4,72%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.398,11	0,42%	1,61%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.460,44	0,35%	-1,24%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.543,89	0,38%	-2,89%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.779,76	0,72%	3,97%	2.872,87	2.412,79
IBEX 35	9.927,00	0,22%	-1,16%	10.758,20	9.327,60
NIKKEI 225	22.052,18	1,21%	-3,13%	24.129,34	19.239,52



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.