

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

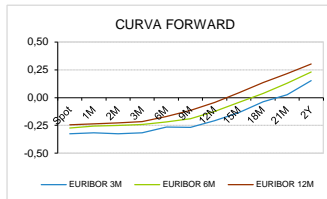
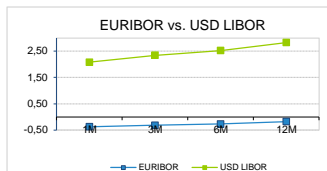
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

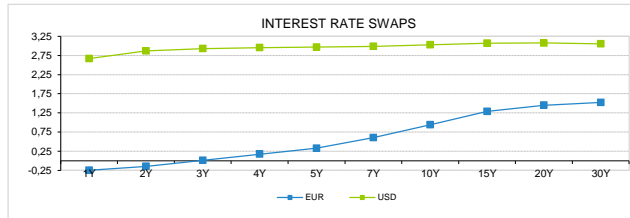
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,0793	0	-1	0,7214	-0,7764
3M	-0,3190	0	0	3M	2,3430	0	1	0,8095	-0,7256
6M	-0,2680	0	0	6M	2,5248	-1	2	0,9098	-0,6484
12M	-0,1760	0	1	12M	2,8274	0	5	1,0546	-0,5152

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2458	0	1	-0,0444	0,6357	1,1620
2Y	-0,1440	-1	3	0,1288	0,7720	1,2710
3Y	0,0120	-1	5	0,2963	0,9010	1,3730
4Y	0,1740	-2	6	0,4486	1,0190	1,4640
5Y	0,3280	-2	6	0,5895	1,1300	1,5450
7Y	0,6040	-3	6	0,8387	1,3213	1,6718
10Y	0,9410	-3	5	1,1310	1,5106	1,7785
15Y	1,2900	-3	5	1,4081	1,6686	1,8534
20Y	1,4530	-3	5	1,5308	1,7123	1,8230
30Y	1,5230	-3	5	1,5618	1,6810	1,7562

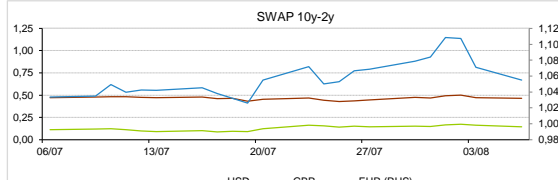
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



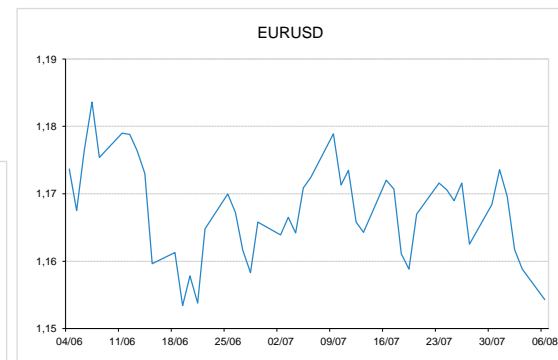
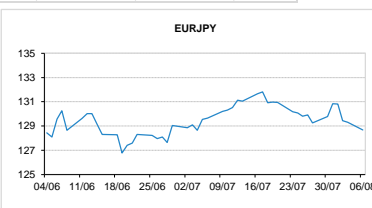
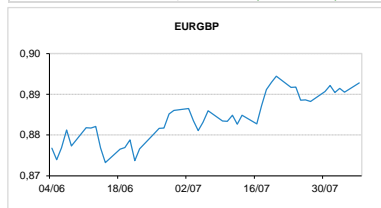
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6700	-1	6	3,0502	2,9715	2,9910
2Y	2,8680	-2	7	3,0276	2,9982	3,0254
3Y	2,9290	-3	7	3,0000	2,9725	3,0402
4Y	2,9530	-3	8	2,9910	3,0115	3,0560
5Y	2,9650	-3	8	3,0168	2,9880	3,0723
7Y	2,9880	-3	10	2,9970	3,0260	3,0620
10Y	3,0280	-3	11	3,0582	3,0786	3,0820
15Y	3,0680	-3	12	3,0811	3,0555	3,1019
20Y	3,0750	-3	13	3,0786	3,0430	3,0520
30Y	3,0510	-3	14	3,0433	3,0345	3,0050



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	74,09	0,88	-2,82	OT 2Y	-0,162	-0,01	-8,10
JETFUEL	701,35	6,77	-14,87	OT 5Y	0,561	-0,02	-7,90
DIESEL	663,10	7,02	-6,62	OT 10Y	1,753	-0,03	-4,80
COBRE	6.176,50	66,50	-285,00	BUND 10Y	-0,177	-2,37	2,40
ZINCO	2.645,00	65,00	-151,25	SCHATZ 2Y	0,025	-0,46	4,60
OURO	1.210,92	-4,98	-44,50	T-NOTE 10Y	3,629	-1,35	5,50
TRIGO	592,50	12,75	62,50	T-NOTE 2Y	3,024	0,78	5,50
LICENÇA C02	17,54	-0,14	1,84	GILT 10Y	1,516	-2,21	3,60


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1543	-0,39%	-1,54%	1,1623	1,1715	1,1904
EUR/GBP	0,8928	-0,26%	-0,77%	0,8956	0,8984	0,9047
EUR/JPY	128,68	0,48%	0,75%	128,68	128,68	128,68
EUR/CHF	1,1522	-0,17%	0,90%	1,1511	1,1499	1,1476
EUR/BRL	4,3018	-0,33%	5,44%	4,3716	4,4442	4,5987
EUR/PLN	4,2579	0,10%	2,27%	4,2812	4,3058	4,3524

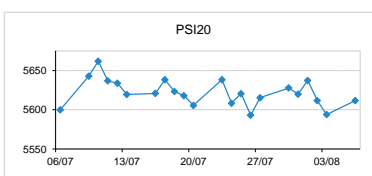

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1543	0,8928	128,68	1,1522	10,3180	7,4521	1,5026	1,56392	4,3018	9,5262
USD	0,8653	-	0,7728	111,435	0,9966	8,9269	6,4477	1,3004	1,3536	3,7272	8,2438

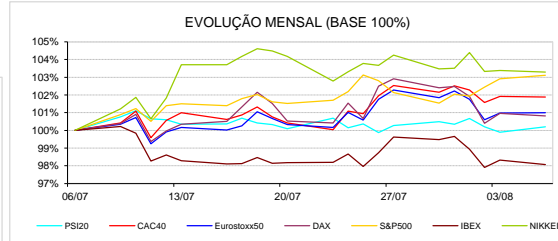
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,880	1,95	71,73
BCP	0,260	-0,80	-4,56
CORT. AMORIM	10,6400	0,38	3,30
CTT	3,0380	1,13	-13,37
EDP	3,515	-0,42	21,84
EDP R	8,810	0,11	26,45
GALP	17,620	1,15	14,98
IBERSOL	9,540	-2,45	-5,78
J MARTINS	12,860	0,23	-20,59
MOTA ENGIL	2,845	-0,52	-22,33
NAVIGATOR	4,998	1,92	18,43
NOS	4,900	-0,20	-10,60
NOVABASE	2,690	0,75	-11,77
PHAROL	0,230	0,22	-8,20
REN	2,496	-0,08	0,69
SEMAPA	20,600	1,48	15,76
SONAE CAP.	0,894	-0,11	0,79
SONAE SGPS	0,981	0,26	-12,88

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	1,95
NAVIGATOR	1,92
SEMAPA	1,48
GALP	1,15
CTT	1,13
NOS	-0,20
EDP	-0,42
MOTA ENGIL	-0,52
BCP	-0,80
IBERSOL	-2,45



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.611,54	0,31%	4,14%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.477,18	-0,03%	3,10%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.482,90	0,01%	-0,60%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.598,21	-0,14%	-2,47%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.845,62	0,18%	6,43%	2.872,87	2.417,35
IBEX 35	9.714,80	-0,26%	-3,28%	10.758,20	9.327,60
NIKKEI 225	22.507,32	-0,08%	-1,13%	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.