

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

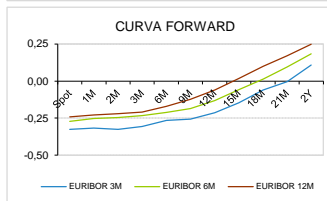
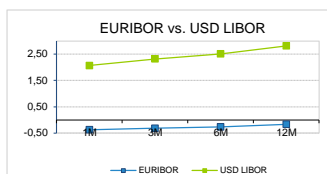
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENDA FIXA**

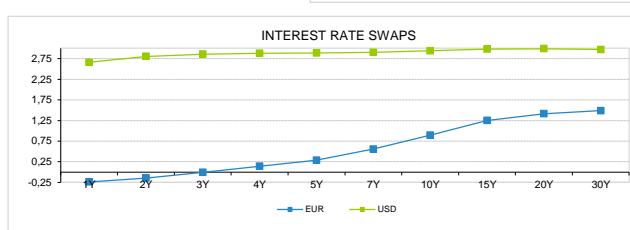
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3700	0	0	1M	2,0668	0	0	0,7221	-0,7768
3M	-0,3190	0	0	3M	2,3193	-2	-2	0,8055	-0,7232
6M	-0,2660	0	0	6M	2,5121	-1	0	0,8993	-0,6494
12M	-0,1660	0	1	12M	2,8155	-1	3	1,0408	-0,5152

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2403	0	2	-0,0601	0,5596	1,1050
2Y	-0,1440	0	3	0,0940	0,6989	1,2226
3Y	-0,0060	-1	2	0,2480	0,8331	1,3292
4Y	0,1410	-2	2	0,3940	0,9588	1,4255
5Y	0,2850	-2	1	0,5330	1,0730	1,5028
7Y	0,5560	-3	2	0,7860	1,2695	1,6374
10Y	0,8930	-3	2	1,0860	1,4696	1,7596
15Y	1,2500	-3	1	1,3740	1,6356	1,8286
20Y	1,4150	-3	1	1,5012	1,6841	1,8078
30Y	1,4880	-3	2	1,5365	1,6550	1,7340

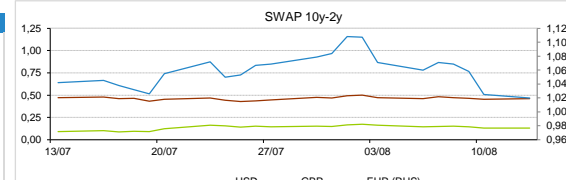
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



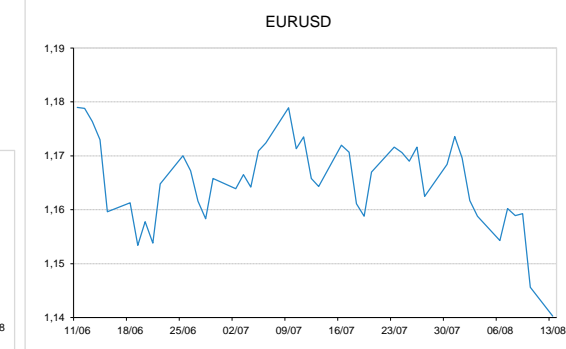
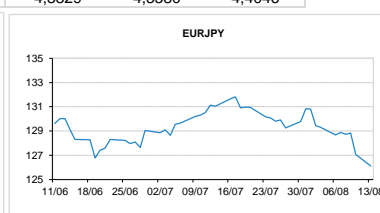
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6580	-1	3	2,9930	2,8920	2,8935
2Y	2,8040	-5	-2	2,9658	2,8870	2,9190
3Y	2,8570	-5	-2	2,9260	2,8920	2,9360
4Y	2,8760	-5	-2	2,9120	2,9010	2,9530
5Y	2,8840	-5	-2	2,9120	2,9115	2,9976
7Y	2,9020	-5	-1	2,9230	2,9445	3,0040
10Y	2,9390	-5	0	2,9806	3,0032	3,0120
15Y	2,9820	-5	1	2,9860	2,9950	3,0085
20Y	2,9910	-5	2	2,9860	3,0090	2,9825
30Y	2,9690	-5	3	2,9550	2,9470	2,9652



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	72,03	-0,78	-3,23	OT 2Y	-0,120	0,05	-2,90
JETFUEL	688,84	-8,82	-11,75	OT 5Y	0,655	0,06	8,70
DIESEL	655,34	-5,32	-2,50	OT 10Y	1,844	0,07	9,70
COBRE	6.155,00	-35,00	-142,50	BUND 10Y	-0,251	-0,29	-4,50
ZINCO	2.542,00	-74,00	-86,00	SCHATZ 2Y	-0,023	-0,69	-0,90
OURO	1.196,29	-15,48	-45,86	T-NOTE 10Y	3,577	1,67	-0,70
TRIGO	557,00	-12,50	44,50	T-NOTE 2Y	2,985	2,34	-0,70
LICENÇA C02	18,08	0,19	2,02	GILT 10Y	1,473	1,34	-2,50


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1403	-0,46%	-2,06%	1,1483	1,1574	1,1760
EUR/GBP	0,8933	0,39%	-0,94%	0,8961	0,8990	0,9050
EUR/JPY	126,11	0,76%	3,91%	126,11	126,11	126,11
EUR/CHF	1,1323	0,31%	3,38%	1,1312	1,1300	1,1277
EUR/BRL	4,4605	-1,17%	0,86%	4,5314	4,6058	4,7779
EUR/PLN	4,3093	-0,38%	0,10%	4,3329	4,3580	4,4046

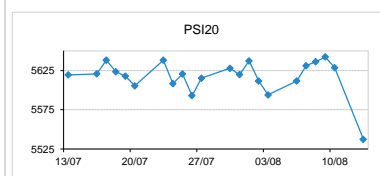

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1403	0,8933	126,11	1,1323	10,4053	7,4532	1,4975	1,56732	4,4605	9,5513
USD	0,8759	-	0,7827	110,765	0,9938	9,1132	6,5290	1,3111	1,3730	3,8872	8,3643

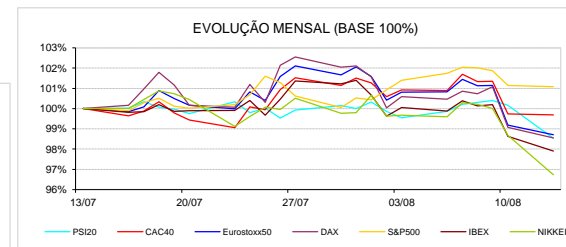
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,670	-3,34	67,67
BCP	0,260	-1,52	-4,41
CORT. AMORIM	10,5400	-0,94	2,33
CTT	3,1560	-2,11	-10,01
EDP	3,424	-1,10	18,68
EDP R	8,780	0,17	26,02
GALP	17,660	-0,39	15,24
IBERSOL	9,640	-0,82	-4,79
J MARTINS	12,925	-0,88	-20,19
MOTA ENGIL	2,850	-1,38	-22,19
NAVIGATOR	4,602	-7,74	9,05
NOS	4,916	-0,85	-10,31
NOVABASE	2,690	-0,74	-11,77
PHAROL	0,227	-1,09	-9,40
REN	2,446	-1,45	-1,33
SEMAPA	18,820	-4,66	5,76
SONAE CAP.	0,857	-1,72	-3,38
SONAE SGPS	0,981	-0,61	-12,88

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP R	0,17
SONAE CAP.	-1,72
CTT	-2,11
ALTRI	-3,34
SEMAPA	-4,66
NAVIGATOR	-7,74



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.537,21	-1,62%	2,76%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.412,32	-0,04%	1,88%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.409,68	-0,48%	-2,69%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.358,74	-0,53%	-4,33%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.831,69	-0,06%	5,91%	2.872,87	2.417,35
IBEX 35	9.530,40	-0,75%	-5,11%	10.643,40	9.327,60
NIKKEI 225	21.857,43	-1,98%	-3,99%	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.