

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

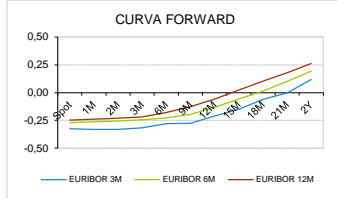
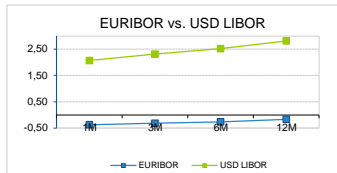
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENDA FIXA**

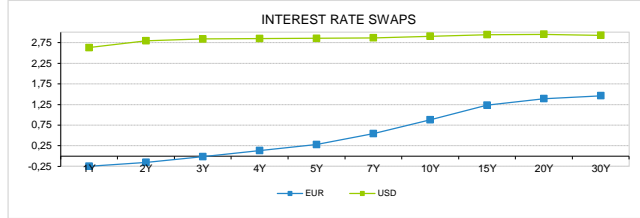
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,0648	0	0	0,7216	-0,7766
3M	-0,3190	0	0	3M	2,3114	0	-2	0,8058	-0,7256
6M	-0,2660	0	0	6M	2,5161	0	0	0,8986	-0,6500
12M	-0,1660	0	1	12M	2,8120	0	1	1,0408	-0,5186

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,2476	0	1	-0,0586	0,5878	1,1137	
2Y	-0,1520	0	1	0,1020	0,7270	1,2235	
3Y	-0,0150	0	0	0,2624	0,8550	1,3290	
4Y	0,1350	1	-1	0,4115	0,9721	1,4230	
5Y	0,2790	1	-1	0,5479	1,0840	1,5040	
7Y	0,5440	1	-2	0,7966	1,2760	1,6396	
10Y	0,8770	1	-2	1,0944	1,4770	1,7560	
15Y	1,2310	0	-3	1,3801	1,6412	1,8240	
20Y	1,3930	0	-3	1,5052	1,6865	1,8003	
30Y	1,4630	0	-4	1,5374	1,6576	1,7280	

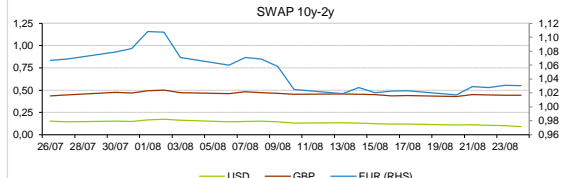
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



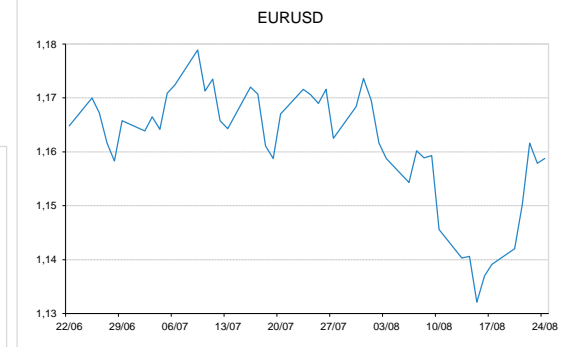
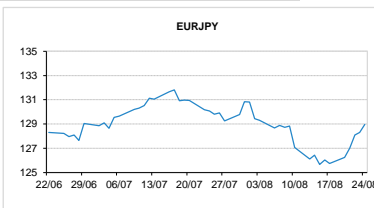
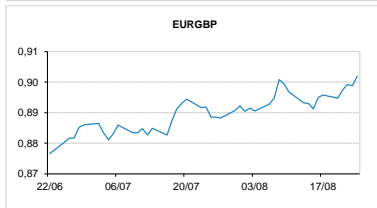
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6270	0	-2	2,9693	2,8747	2,8795
2Y	2,7940	-1	-3	2,9280	2,8520	2,8887
3Y	2,8370	-1	-4	2,9245	2,8572	2,8830
4Y	2,8490	-1	-5	2,9096	2,8790	2,9287
5Y	2,8530	-1	-5	2,9031	2,8917	2,9459
7Y	2,8660	-1	-5	2,9090	2,9223	2,9718
10Y	2,9040	-1	-5	2,9389	2,9330	2,9610
15Y	2,9440	-1	-4	2,9627	2,9673	2,9590
20Y	2,9520	-1	-4	2,9610	2,9570	2,9360
30Y	2,9290	-1	-4	2,9288	2,8920	2,9127



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	76,18	1,45	2,38	OT 2Y	-0,195	0,00	-6,00
JETFUEL	718,00	12,75	17,83	OT 5Y	0,608	0,03	5,10
DIESEL	683,50	12,92	24,33	OT 10Y	1,823	0,02	9,00
COBRE	5.965,00	-18,50	-143,50	BUND 10Y	-0,229	-0,15	-5,20
ZINCO	2.482,00	2,25	-79,50	SCHATZ 2Y	0,007	-0,23	-0,90
OURO	1.208,31	20,29	-16,97	T-NOTE 10Y	3,540	0,33	-9,80
TRIGO	536,75	-5,00	7,50	T-NOTE 2Y	2,988	1,56	-4,30
LICENÇA C02	20,65	0,27	3,55	GILT 10Y	1,483	-0,10	-0,10


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1588	0,08%	-1,01%	1,1669	1,1763	1,1952
EUR/GBP	0,902	-0,36%	-1,13%	0,9048	0,9078	0,9141
EUR/JPY	128,97	-0,51%	0,85%	128,97	128,97	128,97
EUR/CHF	1,1424	-0,30%	1,67%	1,1412	1,1400	1,1376
EUR/BRL	4,7663	-0,25%	-7,97%	4,8369	4,9161	5,0863
EUR/PLN	4,2740	0,18%	0,69%	4,2958	4,3184	4,3661

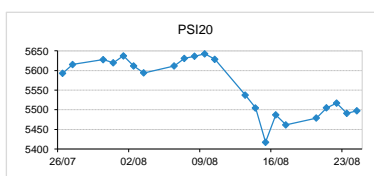

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1588	0,9020	128,97	1,1424	10,5981	7,4594	1,5141	1,58588	4,7663	9,6860
USD	0,8602	-	0,7777	111,21	0,9827	9,1124	6,4164	1,3036	1,3642	4,0795	8,3296

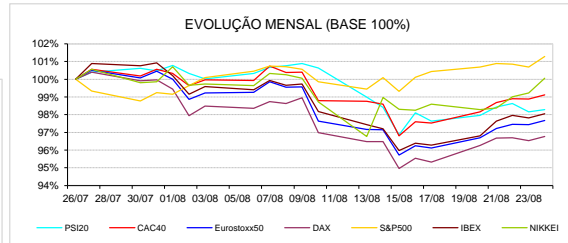
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	8,310	-0,36	60,70
BCP	0,255	-0,47	-6,36
CORT. AMORIM	10,8000	-0,92	4,85
CTT	3,3000	-0,30	-5,90
EDP	3,370	-0,77	16,81
EDP R	8,690	0,40	24,73
GALP	17,640	0,54	15,11
IBERSOL	9,800	-0,41	-3,21
J MARTINS	13,400	1,90	-17,26
MOTA ENGIL	2,795	-1,93	-23,70
NAVIGATOR	4,432	0,27	5,02
NOS	4,958	-0,20	-9,54
NOVABASE	2,700	0,00	-11,45
PHAROL	0,219	6,07	-12,60
REN	2,446	0,25	-1,33
SEMAPA	17,920	-0,11	0,70
SONAE CAP.	0,885	-0,56	-0,23
SONAE SGPS	0,939	-0,27	-16,61

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	6,07
J MARTINS	1,90
GALP	0,54
EDP R	0,40
NAVIGATOR	0,27
BCP	-0,47
SONAE CAP.	-0,56
EDP	-0,77
CORT. AMORIM	-0,92
MOTA ENGIL	-1,93



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.497,20	0,12%	2,02%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.432,50	0,24%	2,26%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.427,44	0,24%	-2,18%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.394,52	0,23%	-4,05%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.874,03	0,59%	7,49%	2.875,23	2.428,20
IBEX 35	9.589,50	0,23%	-4,52%	10.643,40	9.327,60
NIKKEI 225	22.601,77	0,85%	-0,72%	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.