

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

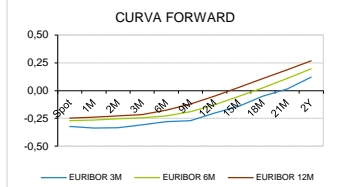
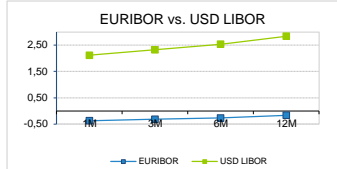
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

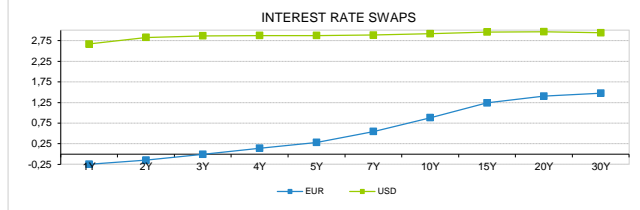
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3700	0	0	1M	2,1138	1	3	0,7231	-0,7826
3M	-0,3190	0	0	3M	2,3208	0	-3	0,8005	-0,7284
6M	-0,2680	0	0	6M	2,5356	0	1	0,8948	-0,6500
12M	-0,1660	0	1	12M	2,8400	0	1	1,0496	-0,5184

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2470	0	0	-0,0500	0,5697	1,0950
2Y	-0,1470	-1	0	0,1060	0,7042	1,2080
3Y	-0,0070	-1	-1	0,2600	0,8340	1,3140
4Y	0,1400	-2	-3	0,4052	0,9550	1,4090
5Y	0,2820	-2	-4	0,5410	1,0680	1,4950
7Y	0,5470	-3	-5	0,7885	1,2610	1,6170
10Y	0,8810	-3	-6	1,0857	1,4679	1,7490
15Y	1,2390	-3	-5	1,3759	1,6365	1,8210
20Y	1,4040	-3	-4	1,5035	1,6861	1,8030
30Y	1,4750	-3	-4	1,5404	1,6580	1,7290

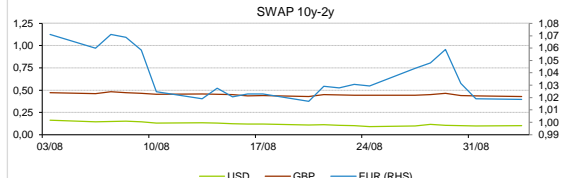
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



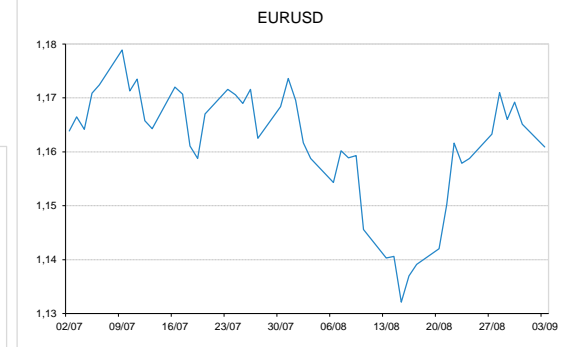
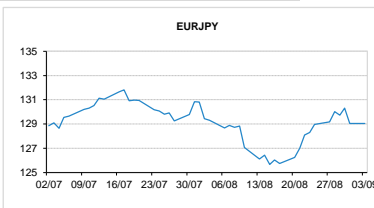
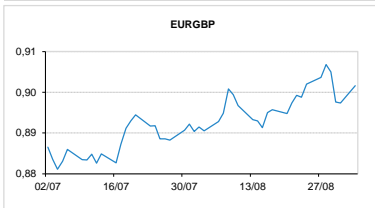
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6660	-1	-1	2,9893	2,8991	2,9375
2Y	2,8280	-2	-5	2,9714	2,8894	2,9378
3Y	2,8660	-3	-8	2,9481	2,8953	2,9464
4Y	2,8740	-3	-9	2,9336	2,9095	2,9711
5Y	2,8740	-3	-10	2,9306	2,9243	2,9867
7Y	2,8830	-3	-11	2,9388	2,9582	3,0209
10Y	2,9160	-3	-12	2,9757	2,9966	3,0341
15Y	2,9560	-3	-11	3,0038	3,0136	3,0341
20Y	2,9640	-3	-10	3,0054	3,0030	3,0079
30Y	2,9400	-3	-10	2,9720	2,9634	2,9606



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	78,14	0,50	4,61	OT 2Y	-0,121	-0,01	2,70
JETFUEL	735,65	9,90	41,07	OT 5Y	0,695	-0,02	9,50
DIESEL	702,90	9,15	46,82	OT 10Y	1,906	-0,02	9,70
COBRE	5.990,00	-91,00	-325,00	BUND 10Y	-0,238	0,44	-14,40
ZINCO	2.464,25	-12,25	-168,75	SCHATZ 2Y	0,002	0,00	-4,80
OURO	1.201,28	1,18	-14,61	T-NOTE 10Y	3,577	0,50	-12,10
TRIGO	545,50	10,50	-27,75	T-NOTE 2Y	3,059	0,78	-6,30
LICENÇA C02	20,20	-0,89	2,52	GILT 10Y	1,551	-2,60	-12,60


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1609	-0,36%	0,18%	1,1690	1,1782	1,1976
EUR/GBP	0,90158	-0,46%	-1,23%	0,9044	0,9073	0,9138
EUR/JPY	129,03	0,02%	0,21%	129,03	129,03	129,03
EUR/CHF	1,1259	-0,15%	2,16%	1,1248	1,1236	1,1212
EUR/BRL	4,8035	-2,08%	-10,74%	4,8818	4,9638	5,1557
EUR/PLN	4,2926	0,25%	-0,71%	4,3146	4,3369	4,3849

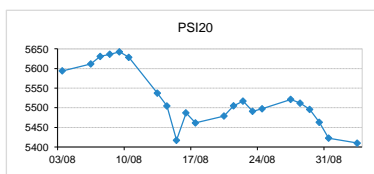

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1609	0,9016	129,03	1,1259	10,5688	7,4539	1,5218	1,61076	4,8035	9,7079
USD	0,8602	-	0,7761	111,035	0,9686	9,0926	6,4118	1,3072	1,3851	4,1281	8,3492

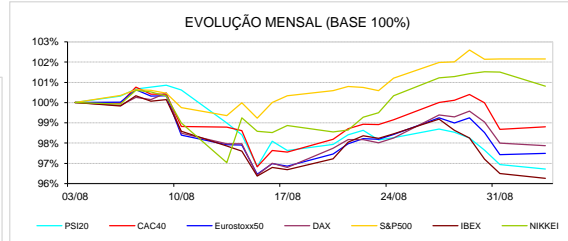
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,970	0,13	54,13
BCP	0,249	-0,60	-8,35
CORT. AMORIM	11,2800	-1,91	9,51
CTT	3,3520	0,06	-4,42
EDP	3,344	-0,62	15,91
EDP R	8,500	-0,53	22,00
GALP	17,690	1,26	15,43
IBERSOL	9,500	-1,04	-6,17
J MARTINS	12,895	-0,08	-20,38
MOTA ENGIL	2,590	-3,18	-29,29
NAVIGATOR	4,298	-0,14	1,85
NOS	4,938	0,45	-9,91
NOVABASE	2,720	0,00	-10,79
PHAROL	0,193	-6,76	-22,80
REN	2,440	0,00	-1,57
SEMAPA	17,400	-2,25	-2,22
SONAE CAP.	0,874	1,63	-1,47
SONAE SGPS	0,915	-0,22	-18,74

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE CAP.	1,63
GALP	1,26
NOS	0,45
ALTRI	0,13
CTT	0,06
IBERSOL	-1,04
CORT. AMORIM	-1,91
SEMAPA	-2,25
MOTA ENGIL	-3,18
PHAROL	-6,76



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.409,89	-0,23%	0,40%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.413,80	0,13%	1,91%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.394,99	0,06%	-3,11%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.346,41	-0,14%	-4,42%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.901,52	0,01%	8,52%	2.916,50	2.446,55
IBEX 35	9.376,10	-0,24%	-6,65%	10.643,40	9.327,60
NIKKEI 225	22.707,38	-0,69%	-0,25%	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.