

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

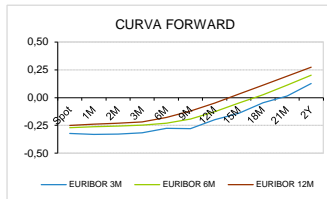
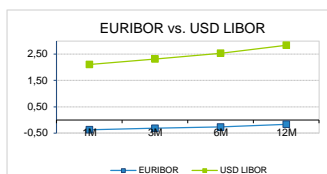
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENDA FIXA**

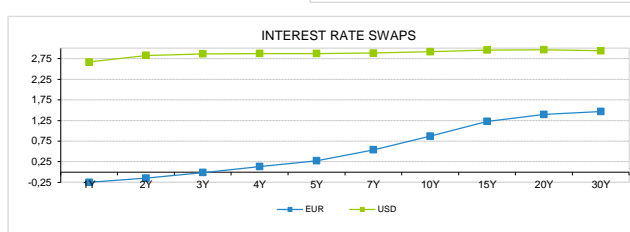
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,1095	0	3	0,7233	-0,7806
3M	-0,3190	0	0	3M	2,3156	-1	-3	0,8003	-0,7284
6M	-0,2690	0	0	6M	2,5350	0	1	0,8940	-0,6500
12M	-0,1660	0	1	12M	2,8389	0	1	1,0414	-0,5184

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2494	0	0	-0,0503	0,5838	1,1130
2Y	-0,1490	0	-1	0,1099	0,7302	1,2230
3Y	-0,0110	0	-2	0,2678	0,8568	1,3339
4Y	0,1340	-1	-4	0,4183	0,9758	1,4288
5Y	0,2750	-1	-5	0,5555	1,0860	1,5060
7Y	0,5390	-1	-7	0,8022	1,2780	1,6442
10Y	0,8710	-1	-7	1,0985	1,4827	1,7625
15Y	1,2300	-1	-6	1,3923	1,6551	1,8350
20Y	1,3950	-1	-6	1,5168	1,7000	1,8145
30Y	1,4680	-1	-6	1,5509	1,6685	1,7385

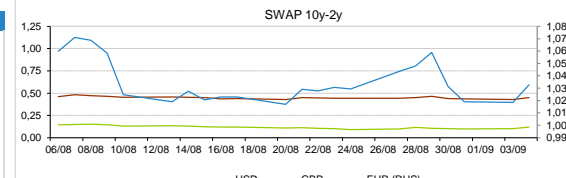
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



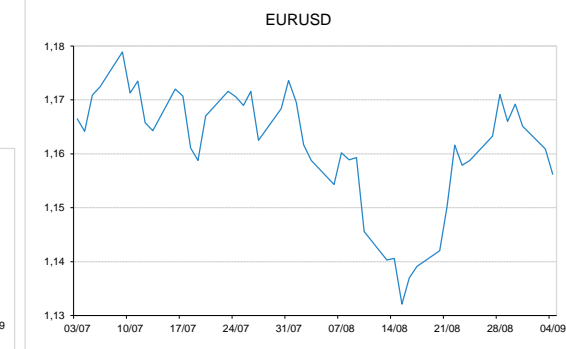
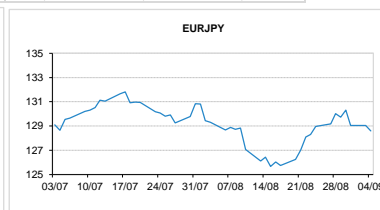
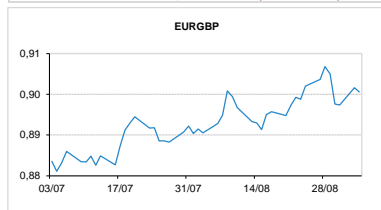
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6660	-1	-1	3,0220	2,9464	2,9390
2Y	2,8280	-2	-5	3,0058	2,9215	2,9740
3Y	2,8660	-3	-8	2,9365	2,9175	2,9950
4Y	2,8740	-3	-9	2,9721	2,9564	3,0150
5Y	2,8740	-3	-10	2,9706	2,9711	3,0347
7Y	2,8830	-3	-11	2,9826	2,9820	3,0624
10Y	2,9160	-3	-12	3,0175	3,0384	3,0265
15Y	2,9560	-3	-11	3,0190	3,0557	3,0739
20Y	2,9640	-3	-10	3,0160	3,0463	3,0210
30Y	2,9400	-3	-10	2,9630	2,9615	2,9720



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	78,33	0,18	4,80	OT 2Y	-0,118	0,00	3,30
JETFUEL	741,43	5,78	46,85	OT 5Y	0,669	-0,03	8,60
DIESEL	704,68	1,78	48,60	OT 10Y	1,870	-0,04	8,80
COBRE	5.948,00	-8,00	-239,00	BUND 10Y	-0,211	2,72	-5,80
ZINCO	2.472,00	7,75	-175,00	SCHATZ 2Y	0,018	1,61	-1,20
OURO	1.191,92	-9,45	-23,97	T-NOTE 10Y	3,611	3,86	-5,40
TRIGO	528,25	-17,25	-51,50	T-NOTE 2Y	3,075	2,35	-2,70
LICENÇA C02	20,20	0,03	2,52	GILT 10Y	1,574	2,12	-5,00


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1562	-0,40%	0,16%	1,1643	1,1735	1,1929
EUR/GBP	0,90058	0,11%	-0,86%	0,9034	0,9063	0,9128
EUR/JPY	128,6	0,33%	0,06%	128,60	128,60	128,60
EUR/CHF	1,1283	-0,21%	2,12%	1,1272	1,1260	1,1237
EUR/BRL	4,8126	0,40%	-10,33%	4,8887	4,9698	5,1613
EUR/PLN	4,3087	-0,37%	-1,22%	4,3306	4,3534	4,4021

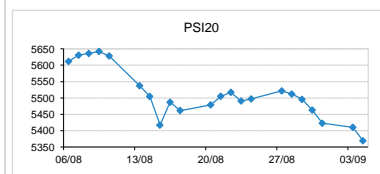

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1562	0,9006	128,60	1,1283	10,5395	7,4547	1,5250	1,61186	4,8126	9,7267
USD	0,8653	-	0,7792	111,345	0,9752	9,1192	6,4501	1,3178	1,3923	4,1477	8,4143

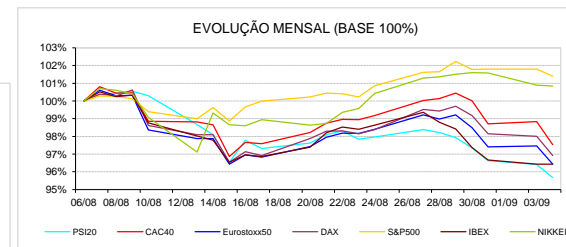
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,890	-1,00	52,58
BCP	0,250	0,36	-8,01
CORT. AMORIM	11,2200	-0,53	8,93
CTT	3,3680	0,48	-3,96
EDP	3,330	-0,42	15,42
EDP R	8,445	-0,65	21,21
GALP	17,475	-1,22	14,03
IBERSOL	9,220	-2,95	-8,94
J MARTINS	12,795	-0,78	-20,99
MOTA ENGIL	2,430	-6,18	-33,66
NAVIGATOR	4,212	-2,00	-0,19
NOS	4,876	-1,26	-11,04
NOVABASE	2,720	0,00	-10,79
PHAROL	0,190	-1,66	-24,08
REN	2,424	-0,66	-2,22
SEMAPA	17,500	0,57	-1,66
SONAE CAP.	0,848	-2,97	-4,40
SONAE SGPS	0,920	0,49	-18,34

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SEMAPA	0,57
SONAE SGPS	0,49
CTT	0,48
BCP	0,36
PHAROL	-1,66
NAVIGATOR	-2,00
IBERSOL	-2,95
SONAE CAP.	-2,97
MOTA ENGIL	-6,18



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.368,78	-0,76%	-0,36%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.342,70	-1,31%	0,57%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.359,36	-1,05%	-4,13%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.210,21	-1,10%	-5,48%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.890,38	-0,38%	8,11%	2.916,50	2.446,55
IBEX 35	9.376,30	0,00%	-6,65%	10.643,40	9.308,80
NIKKEI 225	22.696,90	-0,05%	-0,30%	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.