

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

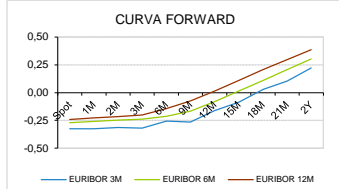
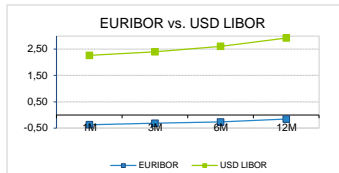
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

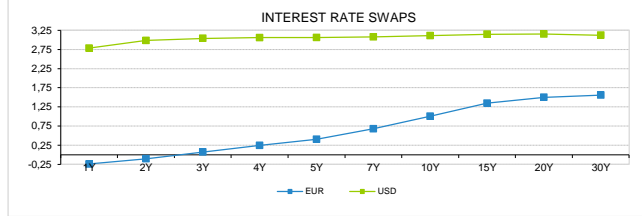
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3710	0	0	1M	2,2651	0	15	0,7211	-0,7776
3M	-0,3180	0	0	3M	2,3981	0	8	0,7994	-0,7322
6M	-0,2680	0	0	6M	2,6063	0	7	0,9024	-0,6548
12M	-0,1570	0	1	12M	2,9255	1	9	1,0679	-0,5196

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2410	0	1	0,0131	0,7184	1,2315
2Y	-0,1030	0	4	0,1993	0,8550	1,3370
3Y	0,0730	0	8	0,3706	0,9785	1,4340
4Y	0,2460	0	11	0,5251	1,0958	1,5220
5Y	0,4040	0	12	0,6631	1,2002	1,6015
7Y	0,6800	1	13	0,9078	1,3803	1,7220
10Y	1,0080	1	13	1,1936	1,5715	1,8340
15Y	1,3480	2	11	1,4698	1,7281	1,8980
20Y	1,5030	2	10	1,5837	1,7642	1,8710
30Y	1,5610	3	9	1,6067	1,7225	1,7871

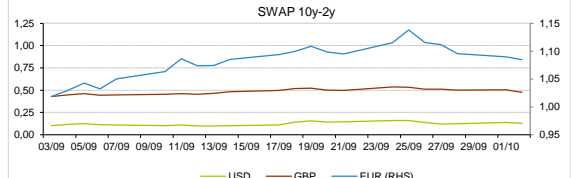
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



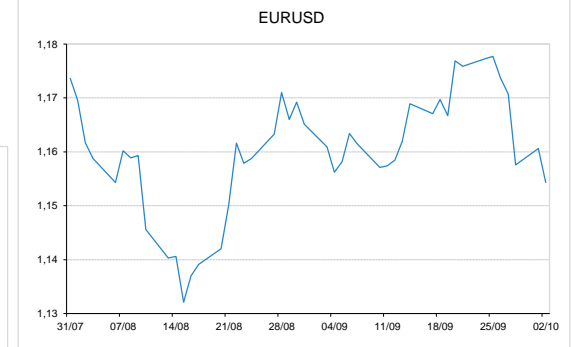
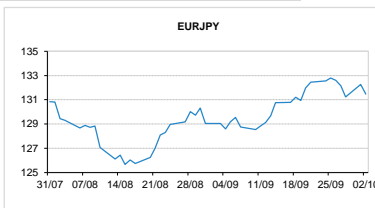
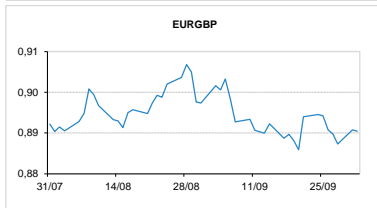
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7840	-1	12	3,1717	3,0971	3,0735
2Y	2,9830	-2	14	3,1420	3,0690	3,0860
3Y	3,0400	-2	16	3,1220	3,0635	3,1040
4Y	3,0570	-2	16	3,1080	3,1002	3,1487
5Y	3,0620	-2	16	3,0960	3,0890	3,1678
7Y	3,0760	-2	16	3,1060	3,1413	3,1670
10Y	3,1100	-2	16	3,1571	3,1490	3,1800
15Y	3,1460	-2	15	3,1585	3,1620	3,1740
20Y	3,1510	-1	15	3,1545	3,1485	3,1490
30Y	3,1210	-1	15	3,1165	3,1050	3,0990



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	85,13	0,15	7,73	OT 2Y	-0,077	0,00	3,40
JETFUEL	789,35	5,77	63,60	OT 5Y	0,757	0,00	4,00
DIESEL	745,85	6,52	52,10	OT 10Y	1,901	0,00	-2,30
COBRE	6.237,50	-9,00	274,00	BUND 10Y	0,030	-6,28	8,80
ZINCO	2.691,50	42,00	230,00	SCHATZ 2Y	0,062	-2,53	4,10
OURO	1.205,69	16,72	5,59	T-NOTE 10Y	3,722	-2,21	15,00
TRIGO	512,25	2,75	-33,25	T-NOTE 2Y	3,200	-1,18	14,90
LICENÇA C02	21,06	-0,31	-0,03	GILT 10Y	1,665	-4,98	8,80


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1543	-0,54%	-0,57%	1,1636	1,1727	1,1928
EUR/GBP	0,89043	0,04%	1,25%	0,8935	0,8965	0,9032
EUR/JPY	131,46	0,60%	-1,85%	131,46	131,46	131,46
EUR/CHF	1,1381	0,02%	-1,06%	1,1368	1,1357	1,1335
EUR/BRL	4,5407	2,51%	6,43%	4,6158	4,6946	4,8812
EUR/PLN	4,2919	-0,20%	0,02%	4,3154	4,3386	4,3876

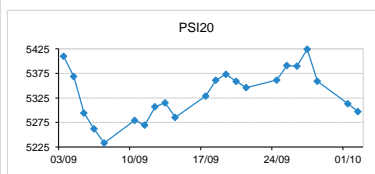

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1543	0,8904	131,46	1,1381	10,3861	7,4560	1,4819	1,60614	4,5407	9,4353
USD	0,8654	-	0,7702	113,655	0,9837	8,9954	6,4522	1,2821	1,3891	3,9561	8,1668

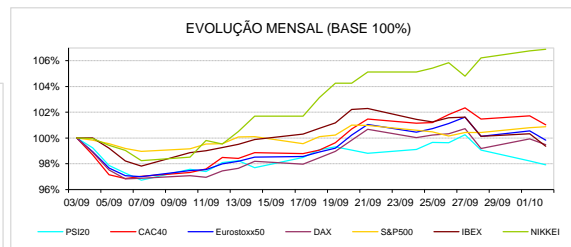
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,240	-0,48	59,35
BCP	0,245	-1,73	-10,11
CORT. AMORIM	11,460	-1,88	11,26
CTT	3,330	-1,07	-5,05
EDP	3,150	0,96	9,19
EDP R	8,620	0,23	23,73
GALP	16,945	0,80	10,57
IBERSOL	9,100	-2,78	-10,12
J MARTINS	12,270	-2,31	-24,24
MOTA ENGIL	1,988	-2,31	-45,73
NAVIGATOR	4,402	1,90	4,31
NOS	5,070	-1,74	-7,50
NOVABASE	2,660	0,00	-12,76
PHAROL	0,168	-3,67	-32,88
REN	2,388	-1,16	-3,67
SEMAPA	17,540	1,62	-1,43
SONAE CAP.	0,700	-5,41	-21,08
SONAE SGPS	0,889	0,34	-21,09

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NAVIGATOR	1,90
SEMAPA	1,62
EDP	0,96
GALP	0,80
SONAE SGPS	0,34
J MARTINS	-2,31
MOTA ENGIL	-2,31
IBERSOL	-2,78
PHAROL	-3,67
SONAE CAP.	-5,41



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.297,05	-0,30%	-1,69%	5.801,45	5.208,33
CAC40	5.469,58	-0,68%	2,96%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.389,23	-0,73%	-3,27%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.283,53	-0,45%	-4,91%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.926,62	0,07%	9,47%	2.940,91	2.520,40
IBEX 35	9.317,00	-0,96%	-7,24%	10.643,40	9.111,10
NIKKEI 225	24.270,62	0,10%	6,61%	24.448,07	20.347,49



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.