

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

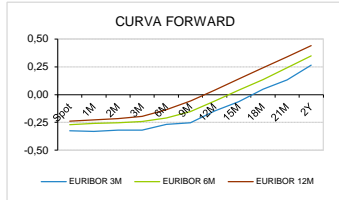
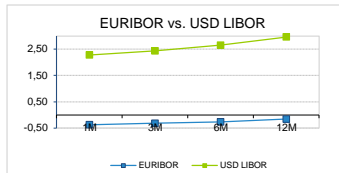
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

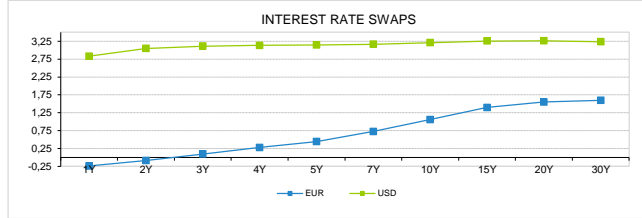
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,2798	0	15	0,7219	-0,7868
3M	-0,3180	0	0	3M	2,4364	0	10	0,8106	-0,7424
6M	-0,2660	0	0	6M	2,6521	2	9	0,9037	-0,6606
12M	-0,1560	0	1	12M	2,9634	1	10	1,0871	-0,5262

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2400	0	1	0,0381	0,8044	1,3350
2Y	-0,0890	0	6	0,2375	0,9492	1,4460
3Y	0,0070	1	10	0,4255	1,0595	1,5410
4Y	0,2780	1	12	0,5893	1,1940	1,6280
5Y	0,4410	1	13	0,7360	1,3000	1,7040
7Y	0,7250	2	14	0,9900	1,4800	1,8190
10Y	1,0560	2	13	1,2789	1,6656	1,9260
15Y	1,3960	2	10	1,5475	1,8098	1,9780
20Y	1,5480	2	9	1,6592	1,8426	1,9450
30Y	1,5960	1	6	1,6728	1,7915	1,8539

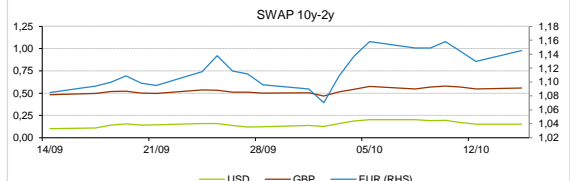
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



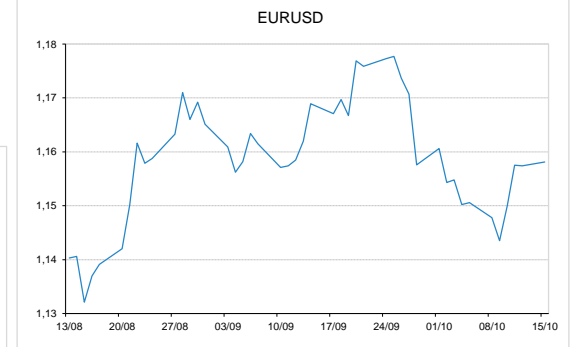
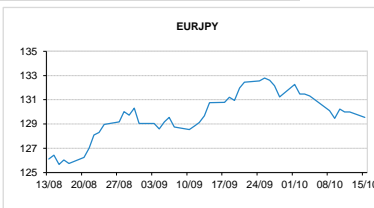
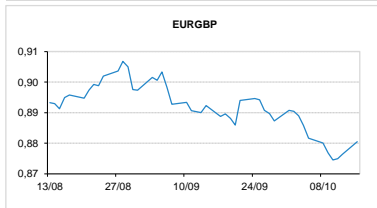
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8290	0	10	3,2532	3,1660	3,2224
2Y	3,0460	0	13	3,2360	3,1530	3,1935
3Y	3,1140	0	15	3,2130	3,1850	3,2488
4Y	3,1330	0	15	3,1960	3,1730	3,2375
5Y	3,1420	0	16	3,1910	3,2194	3,2876
7Y	3,1650	0	18	3,2290	3,2000	3,3136
10Y	3,2100	0	19	3,2648	3,2884	3,3030
15Y	3,2560	0	20	3,2460	3,3009	3,2950
20Y	3,2640	0	20	3,2895	3,2892	3,2943
30Y	3,2370	0	20	3,2175	3,2215	3,2430



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	80,39	-0,04	2,78	OT 2Y	-0,092	0,00	2,90
JETFUEL	764,25	-3,00	29,25	OT 5Y	0,836	-0,03	15,60
DIESEL	722,25	-3,75	25,50	OT 10Y	2,004	-0,04	13,90
COBRE	6,288,50	60,00	305,00	BUND 10Y	0,116	0,46	7,50
ZINCO	2,676,00	42,00	306,75	SCHATZ 2Y	0,062	-1,15	-1,60
OURO	1,226,82	6,88	31,68	T-NOTE 10Y	3,799	1,88	13,60
TRIGO	518,50	1,25	7,00	T-NOTE 2Y	3,239	1,57	7,00
LICENÇA C02	18,74	-1,63	-1,23	GILT 10Y	1,738	-2,16	9,90


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1581	0,06%	-0,77%	1,1677	1,1770	1,1974
EUR/GBP	0,88045	-0,46%	0,94%	0,8835	0,8866	0,8932
EUR/JPY	129,53	0,36%	0,97%	129,53	129,53	129,53
EUR/CHF	1,1445	0,26%	-1,65%	1,1432	1,1420	1,1396
EUR/BRL	4,3148	1,58%	11,91%	4,3847	4,4549	4,6206
EUR/PLN	4,2907	0,10%	0,22%	4,3145	4,3378	4,3869

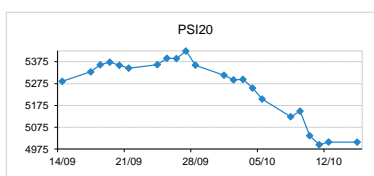

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1581	0,8805	129,53	1,1445	10,3552	7,4609	1,5030	1,62242	4,3148	9,4422
USD	0,8633	-	0,761	111,785	0,9877	8,9427	6,4408	1,2984	1,4001	3,7262	8,1583

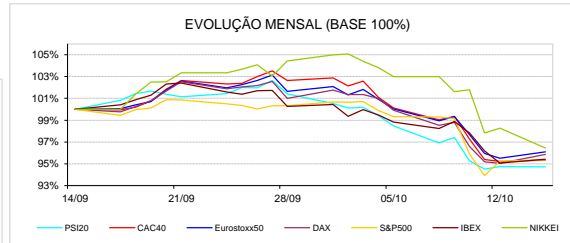
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,470	-3,36	44,46
BCP	0,234	2,90	-13,82
CORT. AMORIM	10,180	-1,93	-1,17
CTT	3,104	-0,19	-11,49
EDP	3,066	0,43	6,27
EDP R	8,120	-0,12	16,55
GALP	15,570	-0,51	1,60
IBERSOL	8,920	-0,89	-11,90
J MARTINS	11,390	-0,65	-29,67
MOTA ENGIL	1,816	-0,77	-50,42
NAVIGATOR	4,094	-0,15	-2,99
NOS	4,870	-0,61	-11,15
NOVABASE	2,390	-0,42	-21,61
PHAROL	0,149	-1,97	-40,40
REN	2,354	0,86	-5,04
SEMAPA	16,820	-0,12	-5,48
SONAE CAP.	0,717	-3,37	-19,17
SONAE SGPS	0,840	-3,67	-25,40

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	2,90
REN	0,86
EDP	0,43
CORT. AMORIM	-1,93
PHAROL	-1,97
ALTRI	-3,36
SONAE CAP.	-3,37
SONAE SGPS	-3,67



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.006,24	-0,01%	-7,09%	5.801,45	4.962,72
CAC40	5.102,99	0,14%	-3,94%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.214,20	0,62%	-8,27%	3.708,82	3.180,61
XTRA DAX	11.622,05	0,85%	-10,03%	13.596,89	11.459,08
S&P 500	2.770,36	0,12%	3,62%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.934,90	0,37%	-11,04%	10.643,40	8.850,20
NIKKEI 225	22.271,30	-1,87%	-2,17%	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.