

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

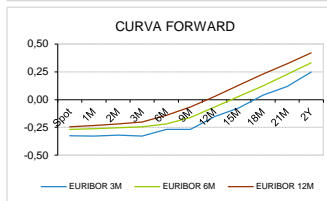
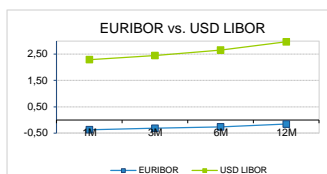
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

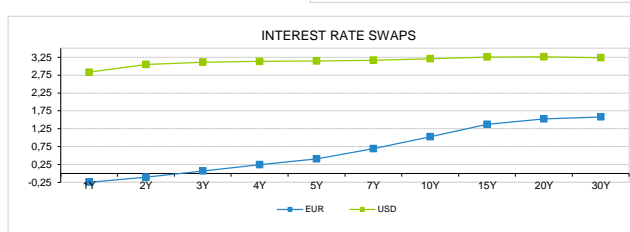
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,2895	1	12	0,7209	-0,7870
3M	-0,3180	0	0	3M	2,4488	1	11	0,8129	-0,7392
6M	-0,2650	0	0	6M	2,6538	0	9	0,9004	-0,6644
12M	-0,1560	0	1	12M	2,9668	0	9	1,0761	-0,5286

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2430	0	1	0,0267	0,7800	1,3211
2Y	-0,1050	-2	4	0,2236	0,9220	1,4289
3Y	0,0700	-3	6	0,4079	1,0500	1,5262
4Y	0,2470	-3	8	0,5710	1,1700	1,6040
5Y	0,4090	-3	9	0,7179	1,2760	1,6820
7Y	0,6940	-3	10	0,9708	1,4570	1,8044
10Y	1,0280	-3	9	1,2578	1,6430	1,9040
15Y	1,3720	-2	8	1,5271	1,7877	1,9570
20Y	1,5270	-2	6	1,6386	1,8201	1,9230
30Y	1,5810	-2	5	1,6515	1,7690	1,8310

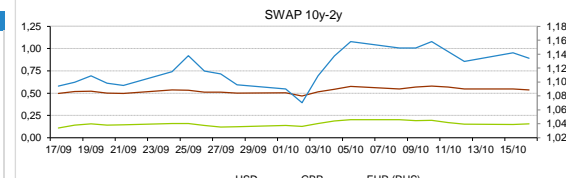
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



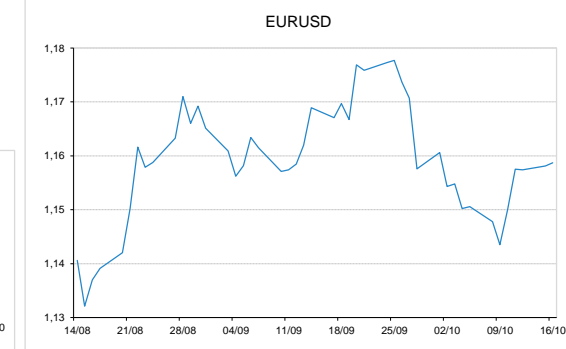
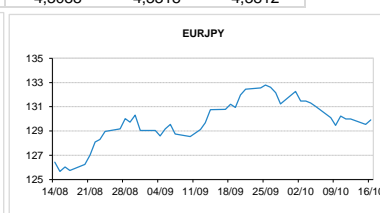
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8290	0	10	3,2685	3,1800	3,1840
2Y	3,0460	0	13	3,2490	3,1630	3,2323
3Y	3,1140	0	15	3,2410	3,1944	3,2531
4Y	3,1330	0	15	3,2253	3,2088	3,2731
5Y	3,1420	0	16	3,2030	3,2249	3,2933
7Y	3,1650	0	18	3,2140	3,2380	3,2970
10Y	3,2100	0	19	3,2530	3,2730	3,3345
15Y	3,2560	0	20	3,3002	3,3093	3,3050
20Y	3,2640	0	20	3,3009	3,2968	3,3018
30Y	3,2370	0	20	3,2648	3,2544	3,2280



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	80,78	0,00	3,17	OT 2Y	-0,102	-0,01	0,40
JETFUEL	763,75	4,25	27,75	OT 5Y	0,782	-0,05	10,00
DIESEL	719,75	2,75	36,50	OT 10Y	1,941	-0,06	8,50
COBRE	6.239,50	-1,00	328,00	BUND 10Y	0,096	-1,06	3,30
ZINCO	2.634,50	-53,50	300,50	SCHATZ 2Y	0,064	0,46	-2,10
OURO	1.228,52	1,47	33,38	T-NOTE 10Y	3,801	0,00	11,10
TRIGO	525,25	0,25	13,75	T-NOTE 2Y	3,251	0,79	5,50
LICENÇA C02	19,37	0,79	-0,60	GILT 10Y	1,739	0,88	7,90


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1587	0,05%	-0,72%	1,1683	1,1775	1,1980
EUR/GBP	0,87593	0,52%	1,46%	0,8790	0,8820	0,8888
EUR/JPY	129,92	-0,30%	0,67%	129,92	129,92	129,92
EUR/CHF	1,1470	-0,29%	-1,87%	1,1458	1,1447	1,1422
EUR/BRL	4,3121	0,33%	12,00%	4,3806	4,4499	4,6143
EUR/PLN	4,2852	0,16%	0,34%	4,3088	4,3318	4,3812

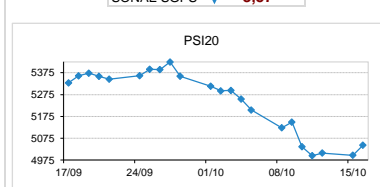

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1587	0,8759	129,92	1,1470	10,3032	7,4610	1,4998	1,62407	4,3121	9,4259
USD	0,8634	-	0,7568	112,195	0,9896	8,8933	6,4417	1,2934	1,4011	3,7039	8,1445

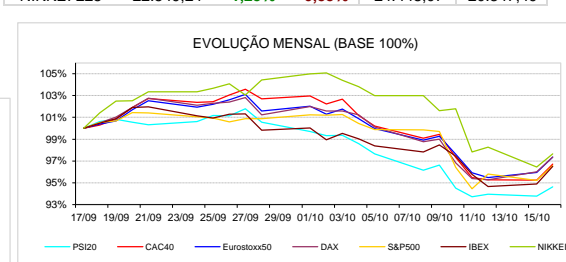
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,590	1,61	46,78
BCP	0,234	-0,17	-13,97
CORT. AMORIM	10,160	-0,20	-1,36
CTT	3,220	3,74	-8,18
EDP	3,119	1,73	8,11
EDP R	8,150	0,37	16,98
GALP	15,565	-0,03	1,57
IBERSOL	8,800	-1,35	-13,09
J MARTINS	11,325	-0,57	-30,07
MOTA ENGIL	1,924	5,95	-47,47
NAVIGATOR	4,200	2,59	-0,48
NOS	5,085	4,41	-7,22
NOVABASE	2,390	0,00	-21,61
PHAROL	0,150	0,67	-40,00
REN	2,382	1,19	-3,91
SEMAPA	17,080	1,55	-4,02
SONAE CAP.	0,711	-0,84	-19,84
SONAE SGPS	0,810	-3,57	-28,06

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	5,95
NOS	4,41
CTT	3,74
NAVIGATOR	2,59
EDP	1,73
CORT. AMORIM	-0,20
J MARTINS	-0,57
SONAE CAP.	-0,84
IBERSOL	-1,35
SONAE SGPS	-3,57



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.042,74	0,92%	-6,41%	5.801,45	4.962,72
CAC40	5.173,05	1,53%	-2,63%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.257,34	1,46%	-7,04%	3.708,82	3.180,61
XTRA DAX	11.776,55	1,40%	-8,83%	13.596,89	11.459,08
S&P 500	2.789,51	1,41%	4,34%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	9.074,70	1,69%	-9,65%	10.643,40	8.850,20
NIKKEI 225	22.549,24	1,25%	-0,95%	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.