

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

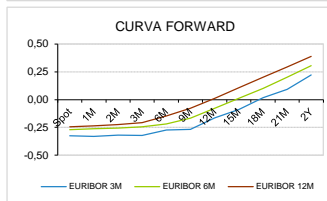
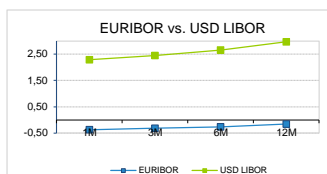
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENDA FIXA**

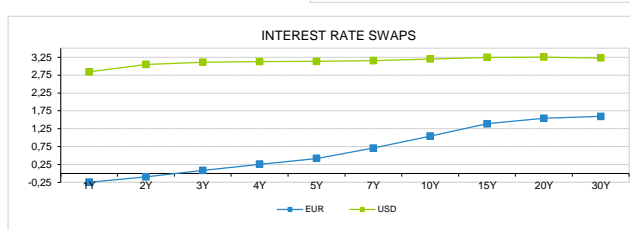
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,2871	0	12	0,7231	-0,7848
3M	-0,3180	0	0	3M	2,4446	0	11	0,8103	-0,7388
6M	-0,2660	0	0	6M	2,6575	0	9	0,9028	-0,6646
12M	-0,1560	0	1	12M	2,9671	0	9	1,0783	-0,5286

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2441	0	1	0,0097	0,7440	1,2818
2Y	-0,0980	1	5	0,2014	0,8845	1,3935
3Y	0,0820	1	7	0,3817	1,0160	1,4918
4Y	0,2590	1	9	0,5427	1,1350	1,5793
5Y	0,4200	1	10	0,6865	1,2430	1,6520
7Y	0,7070	1	11	0,9390	1,4266	1,7743
10Y	1,0430	2	11	1,2285	1,6119	1,8840
15Y	1,3870	2	9	1,5003	1,7595	1,9375
20Y	1,5400	1	8	1,6131	1,7948	1,9058
30Y	1,5930	1	6	1,6290	1,7490	1,8135

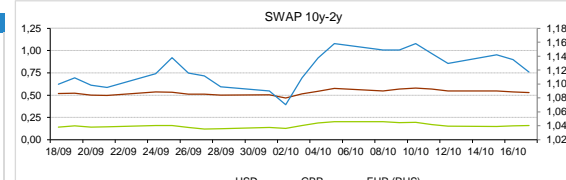
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



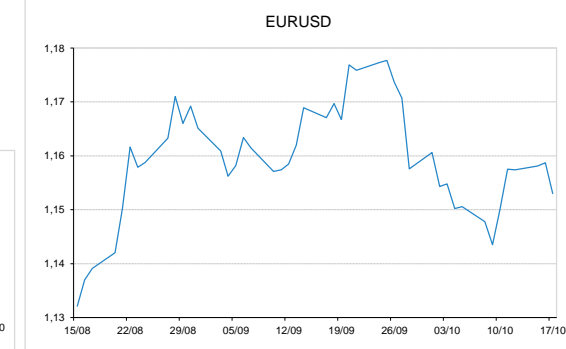
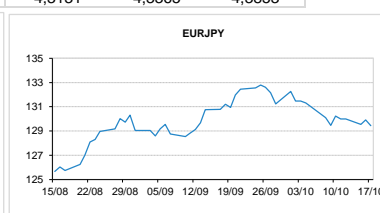
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8390	1	10	3,2665	3,1870	3,1790
2Y	3,0490	0	10	3,2662	3,2007	3,1980
3Y	3,1100	0	10	3,2320	3,2041	3,2200
4Y	3,1270	-1	11	3,2339	3,1960	3,2490
5Y	3,1330	-1	11	3,2070	3,1960	3,2975
7Y	3,1550	-1	12	3,2170	3,2676	3,2800
10Y	3,1990	-1	14	3,2805	3,2640	3,2955
15Y	3,2460	-1	15	3,2675	3,2720	3,2900
20Y	3,2550	-1	16	3,2777	3,2740	3,2770
30Y	3,2300	-1	16	3,2270	3,2150	3,2260



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	79,91	-1,50	2,32	OT 2Y	-0,112	-0,01	-0,20
JETFUEL	759,92	-3,83	36,42	OT 5Y	0,784	0,00	11,70
DIESEL	715,92	-3,83	32,17	OT 10Y	1,948	0,01	11,70
COBRE	6.233,00	-86,00	242,00	BUND 10Y	0,068	-2,88	-0,60
ZINCO	2.644,50	10,00	310,50	SCHATZ 2Y	0,050	-1,38	-4,20
OURO	1.227,03	-1,46	24,49	T-NOTE 10Y	3,797	0,34	10,20
TRIGO	517,50	-6,00	11,25	T-NOTE 2Y	3,247	0,00	5,10
LICENÇA C02	19,27	-0,02	-1,67	GILT 10Y	1,707	-3,63	4,00


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,153	-0,49%	-1,21%	1,1629	1,1722	1,1924
EUR/GBP	0,87945	-0,40%	1,06%	0,8825	0,8856	0,8922
EUR/JPY	129,43	0,38%	1,05%	129,43	129,43	129,43
EUR/CHF	1,1455	0,07%	-1,74%	1,1443	1,1431	1,1407
EUR/BRL	4,24	1,65%	13,83%	4,3085	4,3766	4,5446
EUR/PLN	4,2885	-0,07%	0,27%	4,3131	4,3365	4,3853

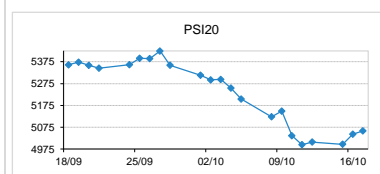

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1530	0,8795	129,43	1,1455	10,3265	7,4604	1,4990	1,61858	4,2400	9,4529
USD	0,8674	-	0,7615	112,085	0,9927	8,9508	6,4713	1,3003	1,4046	3,7003	8,2044

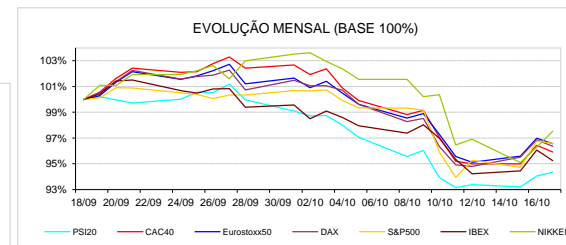
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,340	-3,29	41,95
BCP	0,235	0,21	-13,79
CORT. AMORIM	10,020	-1,38	-2,72
CTT	3,312	2,86	-5,56
EDP	3,140	0,67	8,84
EDP R	8,135	-0,18	16,76
GALP	15,630	0,42	1,99
IBERSOL	8,800	0,00	-13,09
J MARTINS	11,350	0,22	-29,92
MOTA ENGIL	1,884	-2,08	-48,57
NAVIGATOR	4,218	0,43	-0,05
NOS	5,130	0,88	-6,40
NOVABASE	2,400	0,42	-21,29
PHAROL	0,149	-0,53	-40,32
REN	2,388	0,25	-3,67
SEMAPA	16,700	-2,22	-6,15
SONAE CAP.	0,730	2,67	-17,70
SONAE SGPS	0,837	3,27	-25,71

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE SGPS	3,27
CTT	2,86
SONAE CAP.	2,67
NOS	0,88
EDP	0,67
PHAROL	-0,53
CORT. AMORIM	-1,38
MOTA ENGIL	-2,08
SEMAPA	-2,22
ALTRI	-3,29



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.058,08	0,30%	-6,13%	5.801,45	4.962,72
CAC40	5.144,95	-0,54%	-3,15%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.243,08	-0,44%	-7,45%	3.708,82	3.180,61
XTRA DAX	11.715,03	-0,52%	-9,31%	13.596,89	11.459,08
S&P 500	2.804,80	-0,18%	4,91%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.997,20	-0,85%	-10,42%	10.643,40	8.850,20
NIKKEI 225	22.841,12	1,29%	0,33%	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.