

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

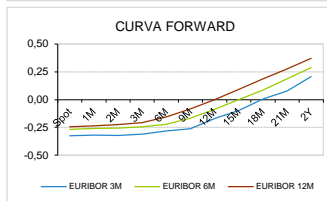
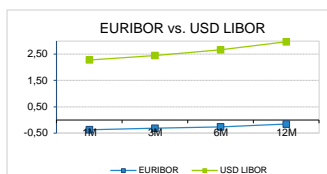
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

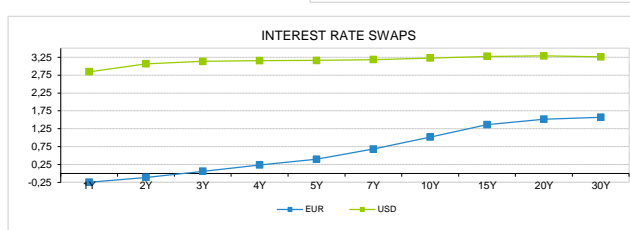
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,2820	-1	11	0,7249	-0,7850
3M	-0,3170	0	0	3M	2,4496	1	11	0,8034	-0,7424
6M	-0,2650	0	0	6M	2,6614	0	9	0,9022	-0,6638
12M	-0,1550	0	1	12M	2,9658	0	9	1,0759	-0,5312

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2451	0	1	-0,0005	0,7180	1,2640
2Y	-0,1110	-1	3	0,1835	0,8600	1,3715
3Y	0,0620	-2	5	0,3620	0,9925	1,4695
4Y	0,2350	-2	6	0,5210	1,1130	1,5555
5Y	0,3940	-3	6	0,6665	1,2210	1,6380
7Y	0,6800	-3	7	0,9190	1,4045	1,7570
10Y	1,0170	-3	7	1,2105	1,5999	1,8665
15Y	1,3620	-3	6	1,4908	1,7541	1,9250
20Y	1,5160	-2	4	1,6049	1,7877	1,8940
30Y	1,5690	-2	3	1,6228	1,7398	1,8037

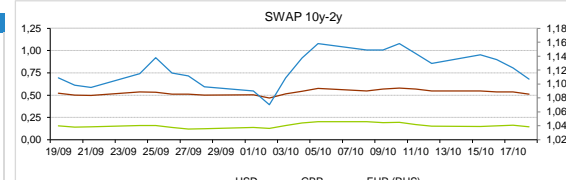
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



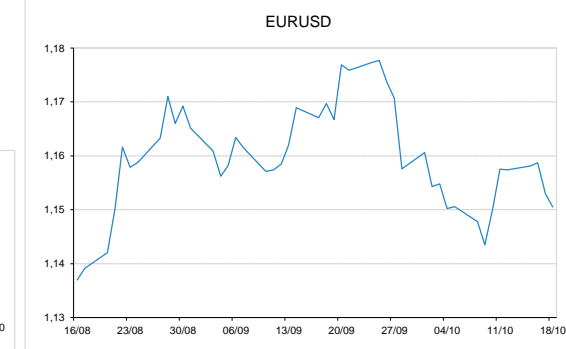
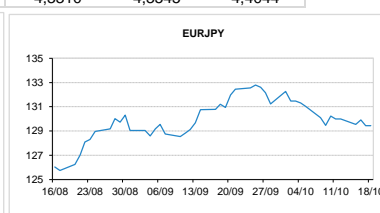
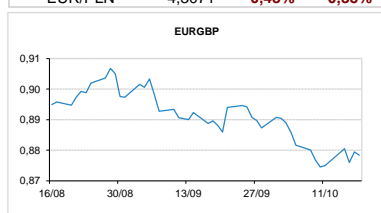
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8450	1	10	3,2898	3,2212	3,1985
2Y	3,0650	2	11	3,2790	3,1835	3,2210
3Y	3,1320	2	12	3,2545	3,1865	3,2776
4Y	3,1520	3	13	3,2340	3,2055	3,2976
5Y	3,1590	3	14	3,2280	3,2492	3,3182
7Y	3,1830	3	15	3,2390	3,2837	3,3165
10Y	3,2270	3	17	3,2785	3,2980	3,3335
15Y	3,2750	3	18	3,3025	3,3070	3,3260
20Y	3,2850	3	19	3,3040	3,2935	3,2995
30Y	3,2590	3	19	3,2630	3,2520	3,2580



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	79,67	-0,38	1,14	OT 2Y	-0,095	0,02	0,60
JETFUEL	759,92	-3,83	36,42	OT 5Y	0,855	0,07	16,40
DIESEL	715,92	-3,83	32,17	OT 10Y	2,033	0,09	17,90
COBRE	6.220,50	4,00	274,00	BUND 10Y	0,025	-3,85	-7,00
ZINCO	2.717,50	73,00	397,50	SCHATZ 2Y	0,016	-3,44	-8,50
OURO	1.229,24	4,64	30,84	T-NOTE 10Y	3,804	-0,86	7,30
TRIGO	511,75	-5,75	1,25	T-NOTE 2Y	3,259	-0,39	4,70
LICENÇA C02	19,67	0,40	-0,56	GILT 10Y	1,676	-2,34	-1,70


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1505	-0,22%	-1,64%	1,1601	1,1695	1,1899
EUR/GBP	0,87843	0,12%	1,28%	0,8814	0,8845	0,8911
EUR/JPY	129,44	-0,01%	1,37%	129,44	129,44	129,44
EUR/CHF	1,1435	0,11%	-1,65%	1,1422	1,1410	1,1387
EUR/BRL	4,2573	-0,39%	14,06%	4,3231	4,3925	4,5605
EUR/PLN	4,3071	-0,48%	-0,35%	4,3310	4,3545	4,4044

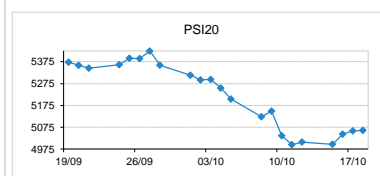

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1505	0,8784	129,44	1,1435	10,3643	7,4607	1,4993	1,61404	4,2573	9,4760
USD	0,8704	-	0,7649	112,495	0,9956	8,9979	6,4934	1,3032	1,4021	3,6993	8,2250

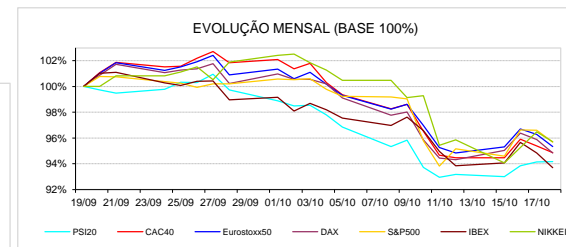
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,290	-0,68	40,98
BCP	0,228	-2,77	-16,18
CORT. AMORIM	10,160	1,40	-1,36
CTT	3,320	0,24	-5,33
EDP	3,138	-0,06	8,77
EDP R	8,130	-0,06	16,69
GALP	15,695	0,42	2,41
IBERSOL	8,740	-0,68	-13,68
J MARTINS	11,360	0,09	-29,85
MOTA ENGIL	1,840	-2,34	-49,77
NAVIGATOR	4,250	0,76	0,71
NOS	5,260	2,53	-4,03
NOVABASE	2,400	0,00	-21,29
PHAROL	0,148	-0,54	-40,64
REN	2,378	-0,42	-4,07
SEMAPA	16,520	-1,08	-7,16
SONAE CAP.	0,730	0,00	-17,70
SONAE SGPS	0,847	1,26	-24,78

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOS	2,53
CORT. AMORIM	1,40
SONAE SGPS	1,26
NAVIGATOR	0,76
GALP	0,42
ALTRI	-0,68
IBERSOL	-0,68
SEMAPA	-1,08
MOTA ENGIL	-2,34
BCP	-2,77



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.060,36	0,05%	-6,09%	5.801,45	4.962,72
CAC40	5.116,79	-0,55%	-3,69%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.211,59	-0,97%	-8,34%	3.708,82	3.180,61
XTRA DAX	11.589,21	-1,07%	-10,28%	13.596,89	11.459,08
S&P 500	2.782,60	-0,98%	4,04%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.889,60	-1,20%	-11,49%	10.643,40	8.850,20
NIKKEI 225	22.658,16	-0,80%	-0,47%	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.