

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

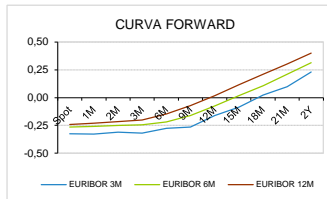
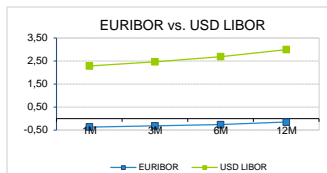
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

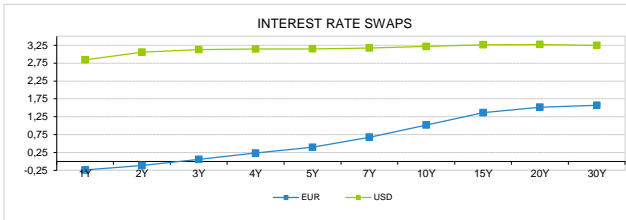
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3700	0	0	1M	2,2796	0	11	0,7250	-0,7854
3M	-0,3170	0	0	3M	2,4690	2	13	0,8038	-0,7440
6M	-0,2620	0	1	6M	2,6941	3	13	0,9045	-0,6652
12M	-0,1540	0	1	12M	3,0006	3	12	1,0753	-0,5298

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2412	0	1	0,0155	0,7739	1,2815
2Y	-0,1150	0	2	0,2052	0,9190	1,3895
3Y	0,0570	-1	4	0,3926	1,0340	1,4855
4Y	0,2340	0	5	0,5595	1,1525	1,5715
5Y	0,3950	0	6	0,7020	1,2555	1,6530
7Y	0,6790	0	7	0,9485	1,4320	1,7615
10Y	1,0160	0	7	1,2330	1,6195	1,8685
15Y	1,3620	0	6	1,5070	1,7671	1,9185
20Y	1,5170	0	6	1,6110	1,7915	1,8870
30Y	1,5700	0	4	1,6220	1,7375	1,7965

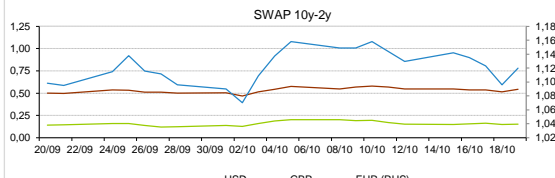
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



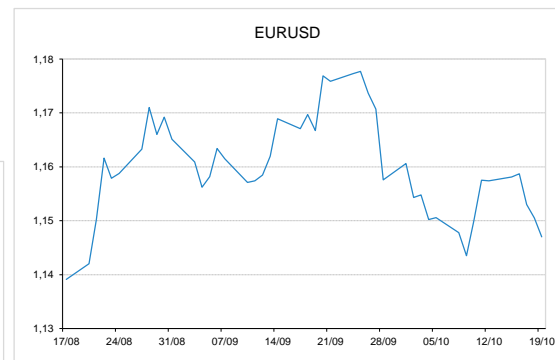
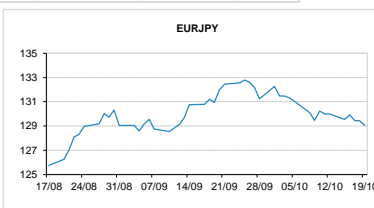
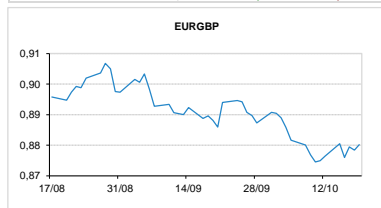
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8430	0	10	3,3138	3,2320	3,2400
2Y	3,0570	-1	11	3,3030	3,2190	3,2645
3Y	3,1250	-1	12	3,2540	3,2230	3,2555
4Y	3,1420	-1	13	3,2605	3,2225	3,3060
5Y	3,1490	-1	13	3,2180	3,2310	3,3509
7Y	3,1710	-1	15	3,2540	3,2925	3,3520
10Y	3,2150	-1	16	3,3284	3,3260	3,3500
15Y	3,2620	-1	17	3,3340	3,3627	3,3590
20Y	3,2710	-1	18	3,3225	3,3497	3,3220
30Y	3,2450	-1	18	3,2920	3,2760	3,2710



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	80,30	1,01	1,38	OT 2Y	-0,069	0,03	2,10
JETFUEL	764,00	3,50	32,75	OT 5Y	0,863	0,01	13,90
DIESEL	719,50	4,00	25,75	OT 10Y	2,019	-0,01	12,70
COBRE	6.132,00	-62,00	71,00	BUND 10Y	0,045	0,91	-5,90
ZINCO	2.735,50	18,00	386,50	SCHATZ 2Y	0,030	1,15	-6,60
OURO	1.226,46	-1,40	22,22	T-NOTE 10Y	3,818	1,54	6,20
TRIGO	516,25	3,25	-6,25	T-NOTE 2Y	3,279	2,36	5,10
LICENÇA C02	19,72	-0,02	-1,75	GILT 10Y	1,701	0,88	-3,80


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,147	-0,30%	-1,69%	1,1566	1,1659	1,1865
EUR/GBP	0,8802	-0,20%	0,90%	0,8832	0,8862	0,8929
EUR/JPY	129,05	0,30%	1,46%	129,05	129,05	129,05
EUR/CHF	1,1485	-0,67%	-1,69%	1,1472	1,1460	1,1436
EUR/BRL	4,2738	-0,17%	12,79%	4,3406	4,4082	4,5791
EUR/PLN	4,2961	0,18%	-0,20%	4,3199	4,3431	4,3926

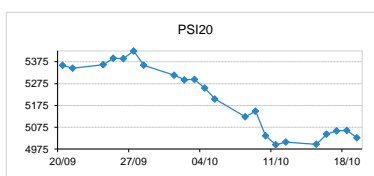

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1470	0,8802	129,05	1,1485	10,3455	7,4607	1,5088	1,61458	4,2738	9,4615
USD	0,8702	-	0,7666	112,495	0,9967	9,0081	6,4923	1,3107	1,4018	3,7097	8,2267

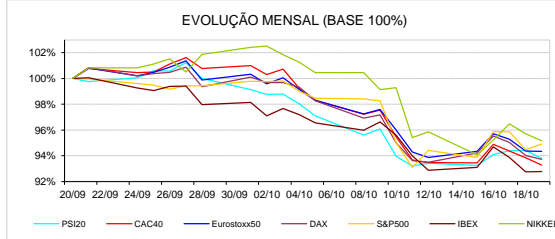
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,400	1,51	43,11
BCP	0,224	-1,75	-17,65
CORT. AMORIM	9,880	-2,76	-4,08
CTT	3,200	-3,61	-8,75
EDP	3,169	0,99	9,84
EDP R	8,155	0,31	17,05
GALP	15,640	-0,35	2,06
IBERSOL	8,780	0,46	-13,28
J MARTINS	11,450	0,79	-29,30
MOTA ENGIL	1,802	-2,07	-50,81
NAVIGATOR	4,102	-3,48	-2,80
NOS	5,140	-2,28	-6,22
NOVABASE	2,480	3,33	-18,66
PHAROL	0,145	-2,56	-42,16
REN	2,360	-0,76	-4,80
SEMAPA	16,500	-0,12	-7,28
SONAE CAP.	0,734	0,55	-17,25
SONAE SGPS	0,850	0,30	-24,56

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOVABASE	3,33
ALTRI	1,51
EDP	0,99
J MARTINS	0,79
SONAE CAP.	0,55
NOS	-2,28
PHAROL	-2,56
CORT. AMORIM	-2,76
NAVIGATOR	-3,48
CTT	-3,61



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.026,02	-0,68%	-6,72%	5.801,45	4.962,72
CAC40	5.084,66	-0,63%	-4,29%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.210,82	-0,02%	-8,37%	3.708,82	3.180,61
XTRA DAX	11.553,83	-0,31%	-10,56%	13.596,89	11.459,08
S&P 500	2.782,32	0,47%	4,05%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.892,10	0,03%	-11,47%	10.643,40	8.768,70
NIKKEI 225	22.532,08	-0,56%	-1,02%	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.