

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

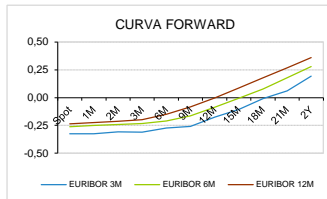
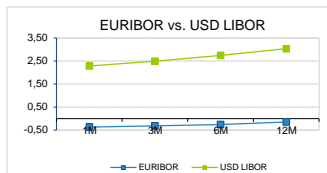
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

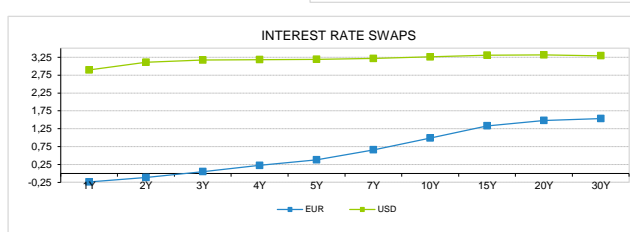
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3700	0	0	1M	2,2814	-1	7	0,7238	-0,7840
3M	-0,3170	0	0	3M	2,4899	0	12	0,8044	-0,7404
6M	-0,2590	0	1	6M	2,7476	2	16	0,9096	-0,6622
12M	-0,1470	0	2	12M	3,0344	0	13	1,0591	-0,5286

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2357	0	1	-0,0060	0,7150	1,2469
2Y	-0,1150	-1	1	0,1786	0,8566	1,3535
3Y	0,0520	-1	2	0,3569	0,9857	1,4445
4Y	0,2240	-2	2	0,5168	1,1022	1,5330
5Y	0,3810	-2	3	0,6595	1,2040	1,6080
7Y	0,6600	-2	3	0,9055	1,3855	1,7387
10Y	0,9900	-3	2	1,1935	1,5784	1,8400
15Y	1,3310	-3	0	1,4690	1,7265	1,8945
20Y	1,4830	-3	-1	1,5815	1,7607	1,8625
30Y	1,5340	-3	-3	1,5965	1,7115	1,7730

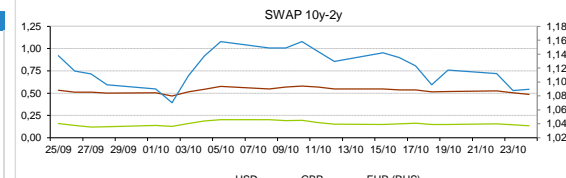
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



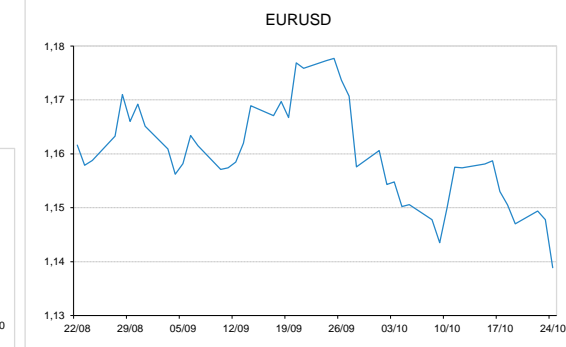
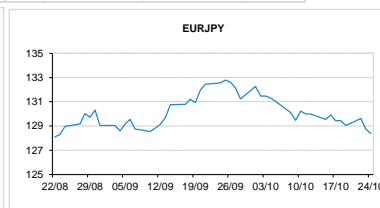
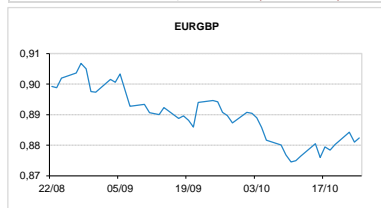
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8950	0	12	3,2246	3,1260	3,1869
2Y	3,1070	0	12	3,2098	3,1404	3,2129
3Y	3,1690	0	12	3,1605	3,1245	3,2160
4Y	3,1850	0	12	3,1495	3,1570	3,2620
5Y	3,1910	0	11	3,1650	3,1760	3,2865
7Y	3,2140	0	12	3,1830	3,2190	3,2960
10Y	3,2580	0	13	3,2501	3,2630	3,3110
15Y	3,3070	0	14	3,2660	3,2820	3,3070
20Y	3,3170	0	15	3,2690	3,2720	3,2830
30Y	3,2930	0	15	3,2370	3,2330	3,2340



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	76,82	0,38	-3,71	OT 2Y	-0,122	-0,03	-3,20
JETFUEL	749,25	-14,50	23,75	OT 5Y	0,802	-0,03	6,00
DIESEL	708,25	-12,75	19,75	OT 10Y	1,982	-0,02	8,40
COBRE	6.183,00	-46,00	-167,00	BUND 10Y	-0,012	-2,78	-13,90
ZINCO	2.717,50	2,50	209,75	SCHATZ 2Y	0,005	-2,29	-11,00
OURO	1.228,62	-2,51	27,53	T-NOTE 10Y	3,753	-3,58	0,40
TRIGO	499,25	-9,75	-27,75	T-NOTE 2Y	3,212	-3,93	0,40
LICENÇA C02	19,59	0,36	-2,84	GILT 10Y	1,586	-3,20	-15,00


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1389	-0,78%	-3,26%	1,1485	1,1575	1,1778
EUR/GBP	0,88233	-0,15%	1,39%	0,8854	0,8884	0,8951
EUR/JPY	128,37	0,30%	3,26%	128,37	128,37	128,37
EUR/CHF	1,1374	0,43%	-0,46%	1,1361	1,1350	1,1325
EUR/BRL	4,2376	0,02%	13,38%	4,3011	4,3559	4,5339
EUR/PLN	4,3063	-0,33%	-0,27%	4,3303	4,3526	4,4023

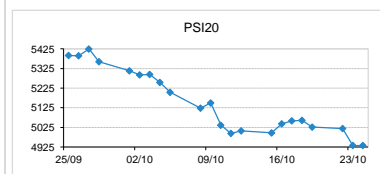

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1389	0,8823	128,37	1,1374	10,3604	7,4605	1,4805	1,6108	4,2376	9,4885
USD	0,8775	-	0,7744	112,545	0,9979	9,0974	6,5465	1,3009	1,4128	3,7196	8,3282

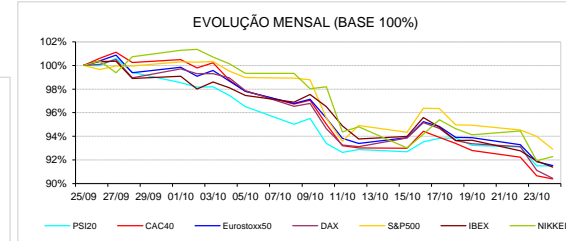
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	6,980	-2,24	34,98
BCP	0,218	-2,06	-19,78
CORT. AMORIM	9,920	3,12	-3,69
CTT	3,160	0,00	-9,89
EDP	3,081	-0,64	6,79
EDP R	7,990	0,63	14,68
GALP	15,160	0,60	-1,08
IBERSOL	8,560	0,23	-15,46
J MARTINS	11,700	2,05	-27,76
MOTA ENGL	1,682	-0,83	-54,08
NAVIGATOR	4,042	-0,25	-4,22
NOS	4,998	-1,13	-8,81
NOVABASE	2,460	-0,81	-19,32
PHAROL	0,140	0,29	-44,08
REN	2,334	0,17	-5,85
SEMAPA	15,720	-1,13	-11,66
SONAE CAP.	0,745	1,50	-16,01
SONAE SGPS	0,866	1,29	-23,09

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	3,12
J MARTINS	2,05
SONAE CAP.	1,50
SONAE SGPS	1,29
EDP R	0,63
MOTA ENGL	-0,83
NOS	-1,13
SEMAPA	-1,13
BCP	-2,06
ALTRI	-2,24



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.932,20	-0,01%	-8,47%	5.801,45	4.923,71
CAC40	4.953,09	-0,29%	-6,77%	5.657,44	4.951,16
ESTX 50 PR	3.130,33	-0,34%	-10,66%	3.708,82	3.128,93
XTRA DAX	11.191,63	-0,73%	-13,36%	13.596,89	11.166,84
S&P 500	2.708,44	-1,16%	1,32%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	8.677,40	-0,56%	-13,61%	10.643,40	8.677,40
NIKKEI 225	22.091,18	0,37%	-2,96%	24.448,07	20.347,49



A informação mencionada é meramente indicativa e reflete 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.