

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

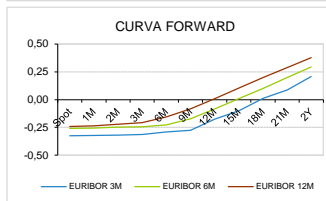
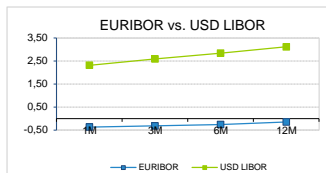
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

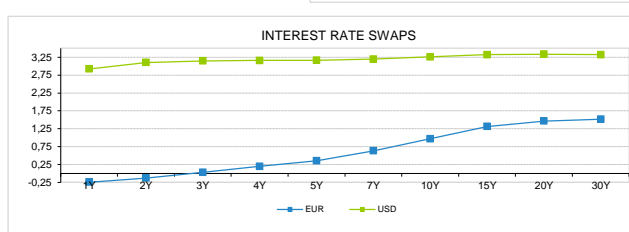
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,3169	0	4	0,7269	-0,7862
3M	-0,3170	0	0	3M	2,5913	0	18	0,8456	-0,7476
6M	-0,2580	0	1	6M	2,8415	1	22	0,9702	-0,6660
12M	-0,1490	0	1	12M	3,1164	0	16	1,1219	-0,5328

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2420	0	0	0,0075	0,7264	1,2620
2Y	-0,1280	0	-4	0,1943	0,8678	1,3730
3Y	0,0320	-1	-7	0,3712	0,9991	1,4680
4Y	0,1980	-1	-9	0,5295	1,1184	1,5565
5Y	0,3540	-1	-10	0,6741	1,2240	1,6350
7Y	0,6340	-1	-10	0,9240	1,4075	1,7505
10Y	0,9690	-1	-9	1,2140	1,5961	1,8590
15Y	1,3150	-1	-8	1,4874	1,7455	1,9100
20Y	1,4670	-1	-8	1,5952	1,7736	1,8765
30Y	1,5180	-1	-8	1,6063	1,7203	1,7810

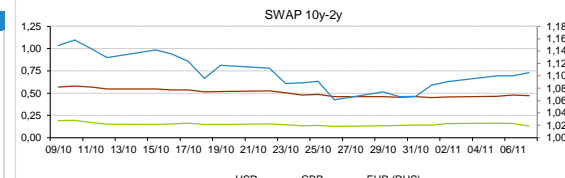
TAXA DE REFERENCIA		BANCO CENTRAL
Zona Euro	0,00	
EUA	2,25	
Reino Unido	0,75	
Japão	0,10	
Canadá	1,75	
Suíça	-0,75	
China	5,75	
Brasil	6,50	
Austrália	1,50	
Índia	4,00	



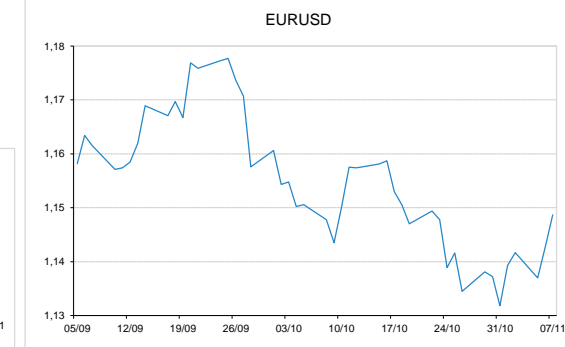
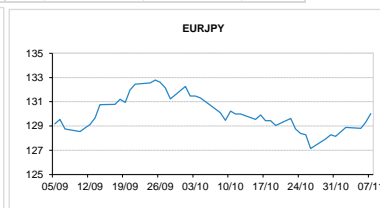
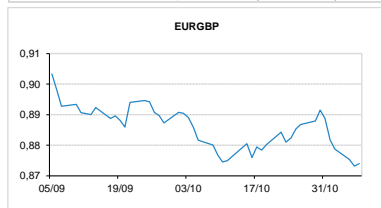
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,9260	0	11	3,2730	3,1755	3,2070
2Y	3,1030	1	4	3,2582	3,1690	3,2290
3Y	3,1480	1	0	3,2270	3,1805	3,2540
4Y	3,1590	1	-1	3,2035	3,2000	3,2790
5Y	3,1660	1	-2	3,2045	3,2185	3,3292
7Y	3,1980	1	-2	3,2275	3,2640	3,3395
10Y	3,2580	1	0	3,2775	3,3115	3,3565
15Y	3,3210	1	2	3,3145	3,3325	3,3555
20Y	3,3370	1	3	3,3165	3,3230	3,3300
30Y	3,3210	1	4	3,2870	3,2755	3,2820



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	72,16	0,03	-11,63	OT 2Y	-0,154	-0,01	-5,20
JETFUEL	726,37	16,35	-64,97	OT 5Y	0,729	0,02	-6,50
DIESEL	687,12	16,10	-59,72	OT 10Y	1,929	0,03	-3,90
COBRE	6.143,50	-33,00	-15,00	BUND 10Y	0,038	1,51	-11,70
ZINCO	2.547,00	-18,50	-126,00	SCHATZ 2Y	0,041	1,61	-5,30
OURO	1.227,70	1,60	26,29	T-NOTE 10Y	3,799	-1,88	-5,10
TRIGO	511,75	-0,25	-9,25	T-NOTE 2Y	3,283	0,00	2,40
LICENÇA C02	18,63	1,06	-3,53	GILT 10Y	1,655	-0,49	-15,40


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1487	0,52%	0,08%	1,1587	1,1677	1,1887
EUR/GBP	0,87403	-0,10%	0,69%	0,8773	0,8803	0,8874
EUR/JPY	130,02	-0,55%	0,07%	130,02	130,02	130,02
EUR/CHF	1,1457	-0,03%	-0,48%	1,1445	1,1434	1,1411
EUR/BRL	4,3106	-0,33%	0,79%	4,3770	4,4400	4,6002
EUR/PLN	4,2878	0,37%	0,76%	4,3132	4,3356	4,3858

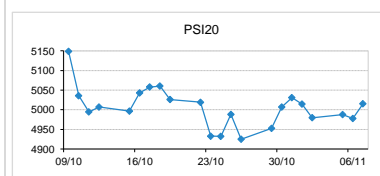

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1487	0,8740	130,02	1,1457	10,3162	7,4601	1,5023	1,57381	4,3106	9,5441
USD	0,8718	-	0,7609	113,33	0,9993	9,0023	6,5037	1,3113	1,3733	3,7631	8,3216

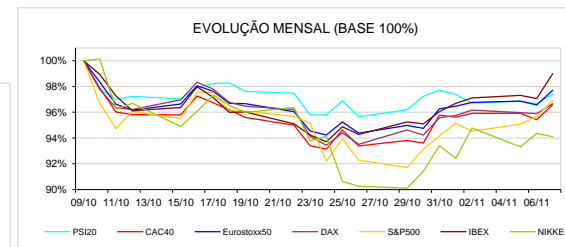
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,440	2,34	43,88
BCP	0,249	1,59	-8,64
CORT. AMORIM	9,770	1,77	-5,15
CTT	3,398	1,43	-3,11
EDP	3,110	-0,16	7,80
EDP R	7,855	0,45	12,75
GALP	15,000	0,00	-2,12
IBERSOL	8,460	0,24	-16,44
J MARTINS	10,815	1,31	-33,22
MOTA ENGIL	1,780	4,22	-51,41
NAVIGATOR	4,142	-0,19	-1,85
NOS	5,190	1,37	-5,31
NOVABASE	2,530	1,61	-17,02
PHAROL	0,165	7,70	-34,00
REN	2,388	0,42	-3,67
SEMAPA	15,860	0,51	-10,87
SONAE CAP.	0,748	-0,27	-15,67
SONAE SGPS	0,864	0,41	-23,27

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	7,70
MOTA ENGIL	4,22
ALTRI	2,34
CORT. AMORIM	1,77
NOVABASE	1,61
EDP	-0,16
NAVIGATOR	-0,19
SONAE CAP.	-0,27



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.015,34	0,76%	-6,92%	5.801,45	4.893,44
CAC40	5.137,94	1,24%	-3,29%	5.657,44	4.896,80
ESTX 50 PR	3.246,16	1,21%	-7,36%	3.695,32	3.090,85
XTRA DAX	11.579,10	0,83%	-10,36%	13.596,89	11.051,04
S&P 500	2.791,72	1,32%	4,42%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	9.167,90	1,99%	-8,72%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	22.085,80	-0,28%	-2,98%	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.