

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

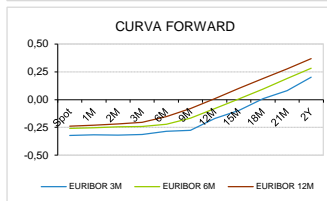
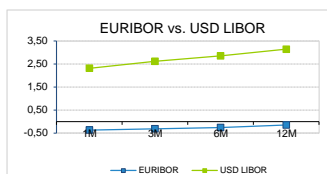
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

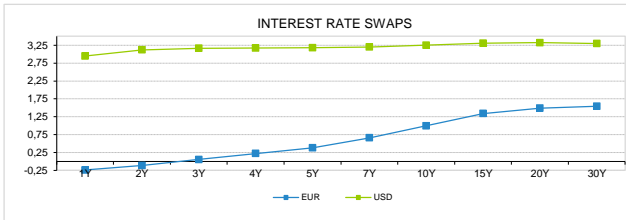
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,3184	0	3	0,7270	-0,7862
3M	-0,3160	0	0	3M	2,6146	1	20	0,8563	-0,7466
6M	-0,2570	0	1	6M	2,8576	1	23	0,9916	-0,6680
12M	-0,1480	0	1	12M	3,1408	2	18	1,1596	-0,5312

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2397	0	0	0,0073	0,7043	1,2304
2Y	-0,1130	1	-2	0,1876	0,8450	1,3434
3Y	0,0540	2	-4	0,3581	0,9724	1,4400
4Y	0,2230	2	-5	0,5128	1,0923	1,5279
5Y	0,3810	2	-6	0,6530	1,1983	1,5970
7Y	0,6610	2	-6	0,9000	1,3798	1,7249
10Y	0,9950	3	-5	1,1870	1,5660	1,8364
15Y	1,3400	3	-5	1,4588	1,7149	1,8921
20Y	1,4920	3	-5	1,5719	1,7491	1,8587
30Y	1,5420	3	-6	1,5855	1,6980	1,7637

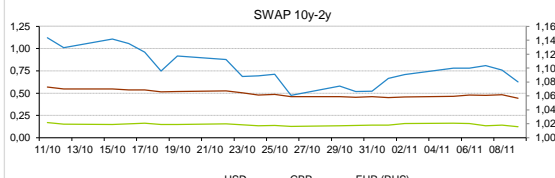
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



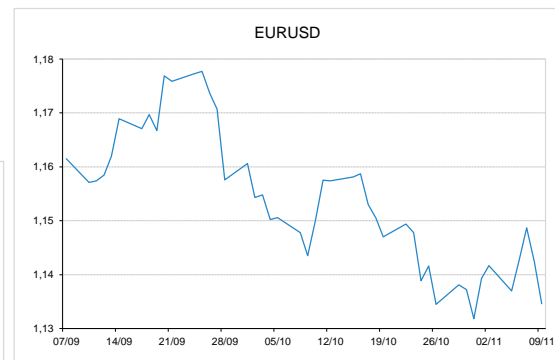
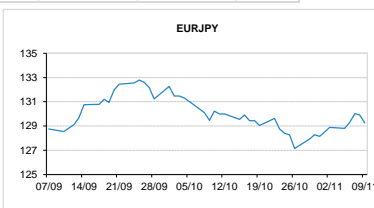
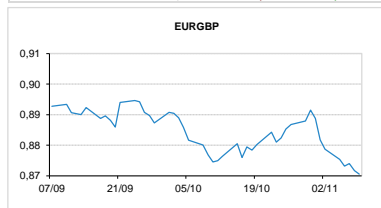
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,9460	2	13	3,2763	3,1932	3,2050
2Y	3,1210	1	6	3,2615	3,1660	3,2270
3Y	3,1650	1	2	3,2390	3,2005	3,2849
4Y	3,1720	1	0	3,2261	3,1960	3,2790
5Y	3,1770	0	-1	3,2289	3,2455	3,3318
7Y	3,1990	0	-2	3,2504	3,2610	3,3636
10Y	3,2510	-1	-1	3,2960	3,3070	3,3570
15Y	3,3070	-1	0	3,3327	3,3270	3,3781
20Y	3,3200	-1	1	3,3140	3,3170	3,3290
30Y	3,2990	-1	2	3,3054	3,3019	3,2800



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	69,99	-0,66	-14,55	OT 2Y	-0,157	0,00	-5,90
JETFUEL	712,65	-13,72	-70,68	OT 5Y	0,745	0,00	-5,30
DIESEL	672,65	-14,47	-67,43	OT 10Y	1,945	0,01	-1,80
COBRE	6.144,00	2,00	-23,00	BUND 10Y	0,002	-4,60	-15,90
ZINCO	2.585,50	78,00	-88,50	SCHATZ 2Y	0,030	-1,38	-7,30
OURO	1.207,88	-15,40	19,70	T-NOTE 10Y	3,806	-3,60	-3,90
TRIGO	502,25	-5,50	-12,75	T-NOTE 2Y	3,283	-3,15	2,00
LICENÇA C02	19,31	-0,25	-1,48	GILT 10Y	1,628	-6,13	-21,80


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1346	-0,68%	-0,78%	1,1444	1,1536	1,1740
EUR/GBP	0,87053	0,13%	0,72%	0,8737	0,8769	0,8840
EUR/JPY	129,26	0,50%	0,15%	129,26	129,26	129,26
EUR/CHF	1,1405	0,37%	-0,10%	1,1393	1,1381	1,1358
EUR/BRL	4,2577	0,33%	0,27%	4,3211	4,3841	4,5392
EUR/PLN	4,2928	-0,35%	0,35%	4,3181	4,3415	4,3907

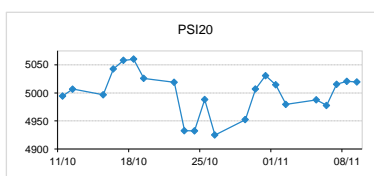

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1346	0,8705	129,26	1,1405	10,2709	7,4600	1,4976	1,5668	4,2577	9,5554
USD	0,8809	-	0,7675	113,715	1,0049	9,0524	6,5712	1,3193	1,3795	3,7585	8,4157

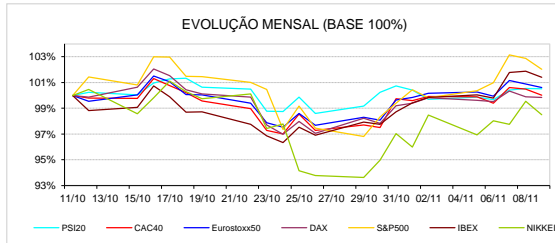
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,340	-1,74	41,95
BCP	0,257	3,68	-5,63
CORT. AMORIM	9,590	-3,23	-6,89
CTT	3,380	-0,35	-3,62
EDP	3,110	-2,14	7,80
EDP R	7,860	0,83	12,82
GALP	14,775	-1,20	-3,59
IBERSOL	8,440	0,24	-16,64
J MARTINS	10,760	-0,42	-33,56
MOTA ENGIL	1,756	0,57	-52,06
NAVIGATOR	4,114	-0,29	-2,51
NOS	5,195	0,78	-5,22
NOVABASE	2,420	-0,82	-20,63
PHAROL	0,170	2,65	-31,84
REN	2,444	0,99	-1,41
SEMAPA	15,640	-1,01	-12,11
SONAE CAP.	0,739	-2,51	-16,69
SONAE SGPS	0,866	0,81	-23,09

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	3,68
PHAROL	2,65
REN	0,99
EDP R	0,83
SONAE SGPS	0,81
GALP	-1,20
ALTRI	-1,74
EDP	-2,14
SONAE CAP.	-2,51
CORT. AMORIM	-3,23



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.019,49	-0,02%	-6,85%	5.801,45	4.893,44
CAC40	5.106,62	-0,48%	-3,88%	5.657,44	4.896,80
ESTX 50 PR	3.229,04	-0,26%	-7,85%	3.687,22	3.090,85
XTRA DAX	11.522,26	-0,04%	-10,80%	13.596,89	11.051,04
S&P 500	2.783,62	-0,81%	4,13%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	9.135,30	-0,45%	-9,05%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	22.250,25	-1,05%	-2,26%	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.