

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

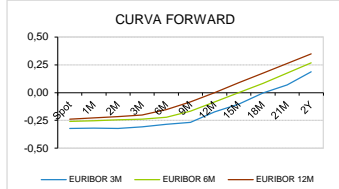
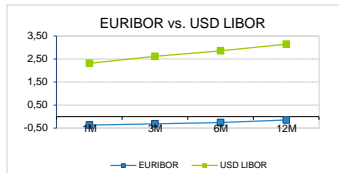
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENDA FIXA**

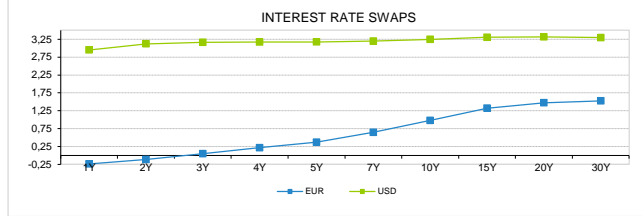
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,3144	0	3	0,7270	-0,7832
3M	-0,3160	0	0	3M	2,6181	0	20	0,8668	-0,7478
6M	-0,2570	0	1	6M	2,8580	0	23	0,9926	-0,6670
12M	-0,1480	0	1	12M	3,1441	0	18	1,1628	-0,5324

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2390	0	0	-0,0002	0,6799	1,2180
2Y	-0,1140	0	-3	0,1739	0,8170	1,3270
3Y	0,0500	0	-5	0,3395	0,9490	1,4260
4Y	0,2150	-1	-8	0,4930	1,0690	1,5150
5Y	0,3680	-1	-9	0,6360	1,1790	1,5920
7Y	0,6460	-2	-10	0,8859	1,3630	1,7140
10Y	0,9780	-2	-10	1,1759	1,5573	1,8260
15Y	1,3220	-2	-10	1,4537	1,7121	1,8825
20Y	1,4740	-2	-10	1,5660	1,7445	1,8515
30Y	1,5240	-2	-11	1,5818	1,6959	1,7595

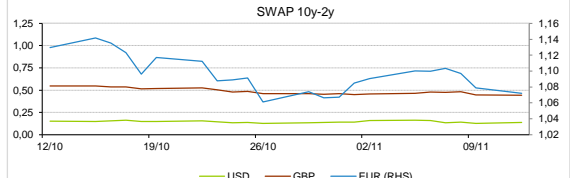
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



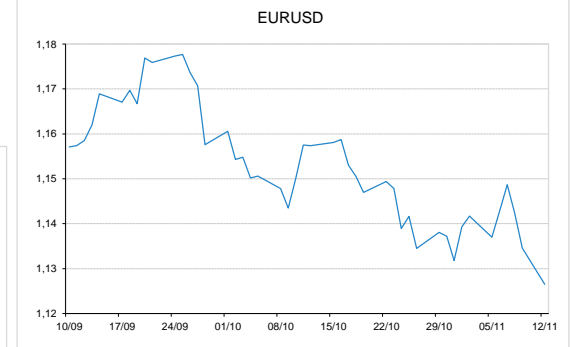
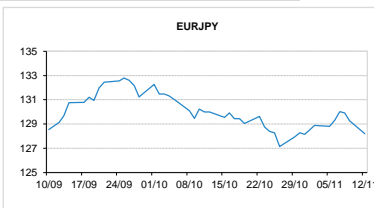
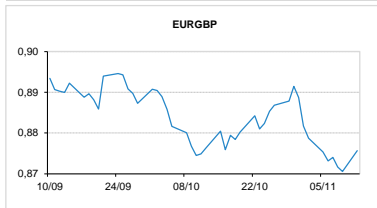
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,9490	-1	12	3,2710	3,1761	3,0425
2Y	3,1220	-1	5	3,2675	3,1795	3,2559
3Y	3,1630	-2	2	3,2381	3,2039	3,2696
4Y	3,1690	-2	0	3,2249	3,2141	3,3056
5Y	3,1730	-2	-1	3,2276	3,2350	3,3008
7Y	3,1960	-3	-1	3,2451	3,2850	3,3648
10Y	3,2470	-3	-1	3,2951	3,3281	3,3813
15Y	3,3030	-3	0	3,3327	3,3494	3,3785
20Y	3,3160	-3	1	3,3371	3,3435	3,3589
30Y	3,2940	-3	2	3,3056	3,3015	3,3045



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	71,07	0,89	-9,00	OT 2Y	-0,156	0,00	-5,70
JETFUEL	701,56	-11,09	-89,10	OT 5Y	0,752	0,01	-8,60
DIESEL	661,06	-11,59	-87,85	OT 10Y	1,946	0,00	-7,50
COBRE	6.039,00	-99,00	-236,00	BUND 10Y	-0,023	-2,10	-14,80
ZINCO	2.585,00	-0,50	-148,00	SCHATZ 2Y	0,016	-0,69	-7,10
OURO	1.204,34	-3,98	-15,60	T-NOTE 10Y	3,773	-3,08	-0,20
TRIGO	514,25	12,25	-3,00	T-NOTE 2Y	3,247	-3,15	2,30
LICENÇA C02	20,46	0,96	0,09	GILT 10Y	1,574	-5,23	-22,70


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1265	-0,71%	-2,67%	1,1363	1,1454	1,1656
EUR/GBP	0,87563	-0,58%	0,09%	0,8789	0,8820	0,8888
EUR/JPY	128,2	0,83%	1,40%	128,20	128,20	128,20
EUR/CHF	1,1346	0,43%	1,13%	1,1334	1,1323	1,1300
EUR/BRL	4,2281	0,06%	3,69%	4,2937	4,3550	4,5060
EUR/PLN	4,3004	-0,29%	-0,13%	4,3262	4,3497	4,3989

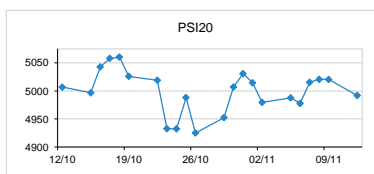

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1265	0,8756	128,20	1,1346	10,2605	7,4604	1,4868	1,5629	4,2281	9,5358
USD	0,8888	-	0,7771	113,775	1,0094	9,1196	6,6306	1,3215	1,3886	3,7564	8,4698

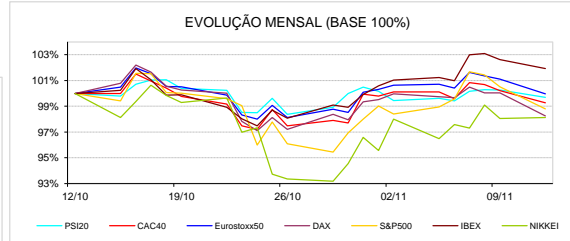
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,110	-3,13	37,50
BCP	0,254	-1,25	-6,80
CORT. AMORIM	9,500	-0,94	-7,77
CTT	3,364	-0,47	-4,08
EDP	3,110	0,00	7,80
EDP R	7,885	0,32	13,18
GALP	14,775	0,00	-3,59
IBERSOL	8,380	-0,71	-17,23
J MARTINS	10,650	-1,02	-34,24
MOTA ENGIL	1,706	-2,85	-53,43
NAVIGATOR	4,034	-1,94	-4,41
NOS	5,130	-1,25	-6,40
NOVABASE	2,420	0,00	-20,63
PHAROL	0,175	2,46	-30,16
REN	2,436	-0,33	-1,73
SEMAPA	15,340	-1,92	-13,80
SONAE CAP.	0,741	0,27	-16,46
SONAE SGPS	0,891	2,89	-20,87

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
SONAE SGPS	2,89
PHAROL	2,46
EDP R	0,32
SONAE CAP.	0,27
NOS	-1,25
SEMAPA	-1,92
NAVIGATOR	-1,94
MOTA ENGIL	-2,85
ALTRI	-3,13



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.991,80	-0,57%	-7,36%	5.801,45	4.893,44
CAC40	5.059,27	-0,93%	-4,77%	5.657,44	4.896,80
ESTX 50 PR	3.193,17	-1,12%	-8,87%	3.687,22	3.090,85
XTRA DAX	11.322,42	-1,79%	-12,35%	13.596,89	11.051,04
S&P 500	2.734,07	-1,68%	2,27%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	9.072,70	-0,68%	-9,67%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	22.269,88	0,09%	-2,17%	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.