

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

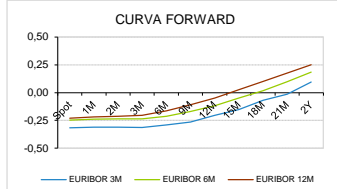
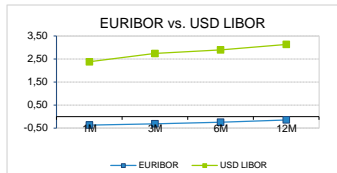
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

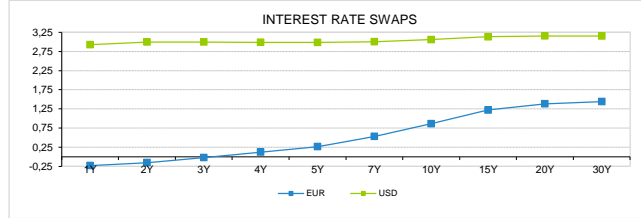
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,3795	0	6	0,7356	-0,8380
3M	-0,3160	0	0	3M	2,7389	-1	15	0,8952	-0,7390
6M	-0,2460	0	1	6M	2,8964	0	7	1,0187	-0,6606
12M	-0,1410	0	1	12M	3,1329	-1	3	1,1549	-0,5272

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2298	1	1	-0,0505	0,5635	1,0988
2Y	-0,1530	-1	-4	0,1010	0,7030	1,2080
3Y	-0,0210	-1	-7	0,2549	0,8340	1,3150
4Y	0,1220	-2	-9	0,4039	0,9562	1,4088
5Y	0,2650	-2	-11	0,5401	1,0640	1,4875
7Y	0,5320	-2	-12	0,7867	1,2560	1,6231
10Y	0,8650	-2	-12	1,0835	1,4591	1,7437
15Y	1,2210	-2	-10	1,3643	1,6173	1,8023
20Y	1,3810	-3	-10	1,4809	1,6572	1,7731
30Y	1,4390	-3	-9	1,5042	1,6186	1,6872

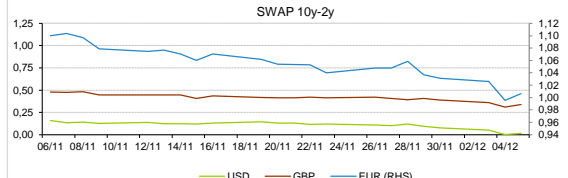
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



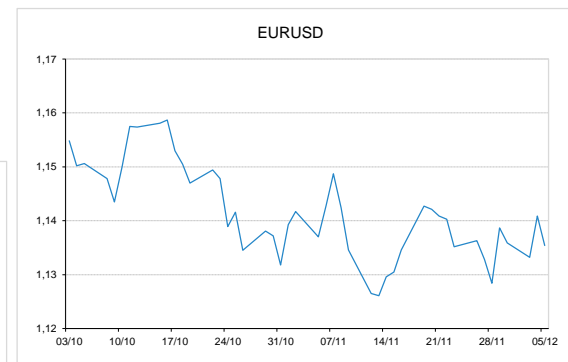
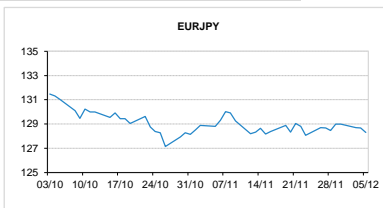
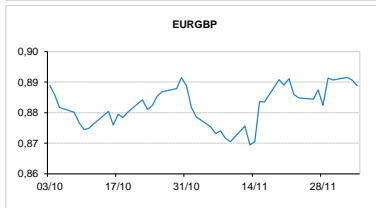
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,9240	2	-1	2,9810	2,9532	2,9174
2Y	2,9950	2	-10	2,9580	2,8732	2,9467
3Y	2,9960	1	-15	2,9563	2,9052	2,9763
4Y	2,9870	1	-17	2,9231	2,9233	3,0082
5Y	2,9830	1	-18	2,9217	2,9447	3,0372
7Y	3,0020	0	-19	2,9449	2,9907	3,0898
10Y	3,0580	0	-19	3,0001	3,0536	3,1150
15Y	3,1320	0	-18	3,0580	3,0859	3,1252
20Y	3,1560	0	-17	3,0717	3,0837	3,1032
30Y	3,1500	0	-16	3,0553	3,0579	3,0662



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,28	0,20	-10,82	OT 2Y	-0,229	0,05	-8,80
JETFUEL	622,35	-2,29	-97,61	OT 5Y	0,566	-0,02	-12,80
DIESEL	581,35	-1,54	-98,11	OT 10Y	1,795	-0,02	-8,90
COBRE	6.168,50	-86,00	-74,00	BUND 10Y	-0,211	0,88	-17,60
ZINCO	2.646,00	5,50	77,50	SCHATZ 2Y	0,039	0,69	-4,80
OURO	1.237,76	-2,36	7,61	T-NOTE 10Y	3,599	-4,54	-23,10
TRIGO	516,25	-6,25	-6,75	T-NOTE 2Y	3,141	-3,14	-16,10
LICENÇA C02	19,70	-1,03	2,47	GILT 10Y	1,517	2,21	-19,50


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1354	-0,48%	-0,14%	1,1446	1,1540	1,1737
EUR/GBP	0,88885	0,19%	-1,52%	0,8918	0,8950	0,9019
EUR/JPY	128,31	0,29%	0,39%	128,31	128,31	128,31
EUR/CHF	1,1326	-0,06%	1,10%	1,1313	1,1302	1,1278
EUR/BRL	4,387	-0,49%	-2,93%	4,4478	4,5188	4,6748
EUR/PLN	4,2862	-0,11%	0,46%	4,3099	4,3342	4,3830

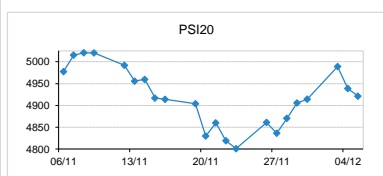

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1354	0,8889	128,31	1,1326	10,1905	7,4633	1,5192	1,56198	4,3870	9,6528
USD	0,8821	-	0,7853	113,145	0,9985	8,9880	6,5831	1,3380	1,3758	3,8705	8,5017

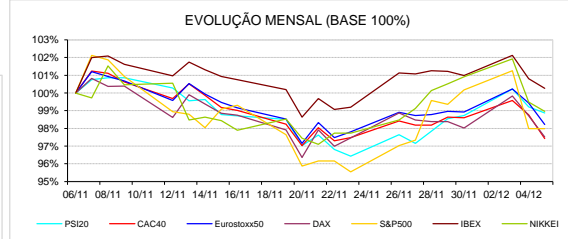
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	6,100	-7,15	17,97
BCP	0,249	0,57	-8,49
CORT. AMORIM	9,610	0,52	-6,70
CTT	3,500	-0,06	-0,20
EDP	3,102	-0,26	7,52
EDP R	7,825	0,26	12,32
GALP	14,765	-0,64	-3,65
IBERSOL	8,140	0,00	-19,60
J MARTINS	10,515	-0,80	-35,07
MOTA ENGIL	1,690	-1,86	-53,86
NAVIGATOR	3,702	0,00	-12,28
NOS	5,390	-1,55	-1,66
NOVABASE	2,380	-1,24	-21,94
PHAROL	0,184	-0,11	-26,40
REN	2,424	0,66	-2,22
SEMAPA	14,080	1,88	-20,88
SONAE CAP.	0,815	0,00	-8,12
SONAE SGPS	0,830	0,85	-26,33

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
SEMAPA	1,88
SONAE SGPS	0,85
REN	0,66
BCP	0,57
CORT. AMORIM	0,52
J MARTINS	-0,80
NOVABASE	-1,24
NOS	-1,55
MOTA ENGIL	-1,86
ALTRI	-7,15



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.921,15	-0,35%	-8,67%	5.801,45	4.783,34
CAC40	4.944,37	-1,36%	-6,93%	5.657,44	4.894,30
ESTX 50 PR	3.150,27	-1,22%	-10,09%	3.687,22	3.090,85
XTRA DAX	11.200,24	-1,19%	-13,29%	13.596,89	11.009,25
S&P 500	2.700,06	-3,24%	0,99%	2.940,91	2.532,69
IBEX 35	9.012,20	-0,55%	-10,27%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	21.919,33	-0,53%	-3,71%	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.