

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

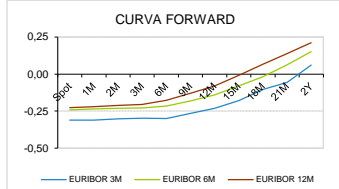
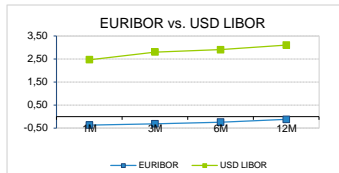
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENDA FIXA**

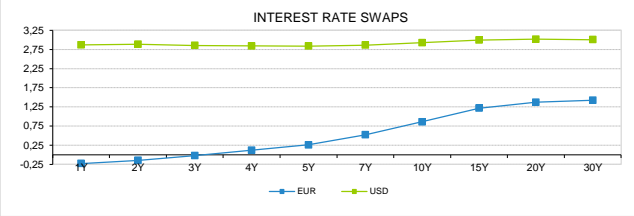
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,4696	1	17	0,7303	-0,8262
3M	-0,3110	0	1	3M	2,8036	0	16	0,9064	-0,7358
6M	-0,2380	0	2	6M	2,9046	0	4	1,0257	-0,6578
12M	-0,1250	0	2	12M	3,1039	1	-2	1,1579	-0,5226

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2274	0	1	-0,0808	0,5324	1,0715
2Y	-0,1450	-1	-2	0,0658	0,6771	1,1875
3Y	-0,0220	-1	-5	0,2206	0,8075	1,2925
4Y	0,1190	0	-6	0,3701	0,9300	1,3865
5Y	0,2590	0	-7	0,5085	1,0430	1,4657
7Y	0,5250	0	-8	0,7595	1,2370	1,6074
10Y	0,8610	0	-8	1,0580	1,4394	1,7140
15Y	1,2180	0	-8	1,3388	1,5928	1,7700
20Y	1,3720	1	-8	1,4534	1,6297	1,7370
30Y	1,4250	1	-9	1,4714	1,5849	1,6520

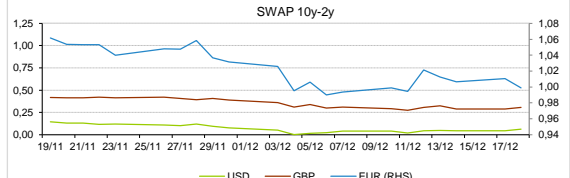
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,25
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



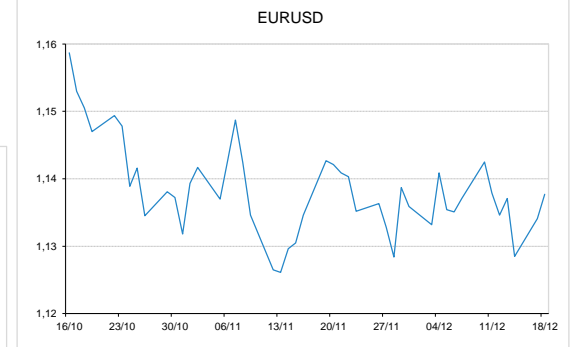
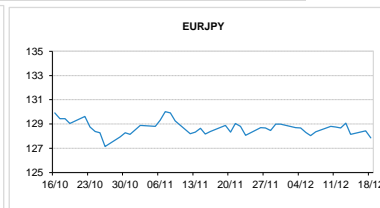
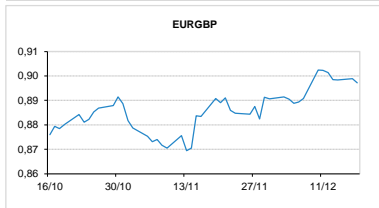
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,8670	-1	-6	2,7852	2,7050	2,8135
2Y	2,8830	-2	-20	2,7120	2,7280	2,8480
3Y	2,8560	-2	-26	2,7351	2,7560	2,9028
4Y	2,8400	-2	-28	2,7230	2,7750	2,9160
5Y	2,8380	-2	-28	2,7300	2,8190	2,9692
7Y	2,8640	-2	-29	2,7800	2,9001	2,9860
10Y	2,9280	-1	-29	2,8635	2,9360	3,0090
15Y	2,9970	-1	-28	2,9230	2,9675	3,0090
20Y	3,0180	-1	-28	2,9370	2,9635	3,0146
30Y	3,0060	-1	-28	2,9200	2,9330	2,9430



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	57,24	-2,37	-9,79	OT 2Y	-0,336	0,02	-19,40
JETFUEL	576,85	-20,15	-104,65	OT 5Y	0,374	-0,02	-40,10
DIESEL	535,00	-19,25	-104,17	OT 10Y	1,635	-0,02	-34,10
COBRE	6.133,50	-8,50	-82,00	BUND 10Y	-0,249	-1,61	-14,10
ZINCO	2.552,50	4,50	-65,50	SCHATZ 2Y	0,053	0,46	-0,40
OURO	1.248,94	2,13	25,47	T-NOTE 10Y	3,512	-1,83	-20,00
TRIGO	532,75	-2,50	17,50	T-NOTE 2Y	2,977	-3,91	-20,00
LICENÇA C02	24,35	-0,25	4,85	GILT 10Y	1,495	1,53	-12,50


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1377	0,32%	-0,44%	1,1467	1,1559	1,1746
EUR/GBP	0,89715	0,20%	-0,70%	0,9001	0,9034	0,9103
EUR/JPY	127,86	0,45%	0,81%	127,86	127,86	127,86
EUR/CHF	1,1282	-0,14%	0,80%	1,1269	1,1258	1,1235
EUR/BRL	4,4389	-0,22%	-2,97%	4,4993	4,5672	4,7145
EUR/PLN	4,2860	-0,09%	1,12%	4,3094	4,3335	4,3810

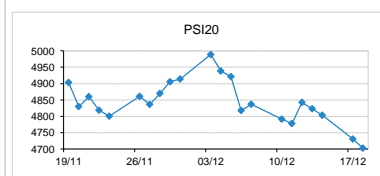

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1377	0,8972	127,86	1,1282	10,3074	7,4677	1,5304	1,58445	4,4389	9,9083
USD	0,8800	-	0,7916	112,605	0,9928	9,0609	6,5715	1,3441	1,3938	3,9045	8,7149

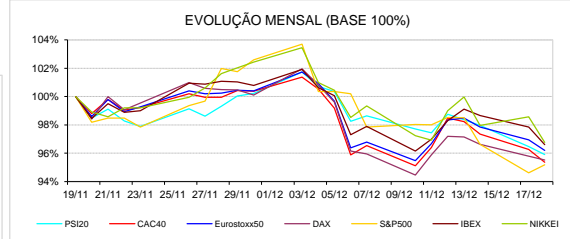
**ACCIONISTA**

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,510	0,73	6,56
BCP	0,233	-1,60	-14,19
CORT. AMORIM	9,160	0,00	-10,24
CTT	3,190	-0,37	-9,04
EDP	2,951	-2,51	2,29
EDP R	7,580	-0,79	8,80
GALP	13,805	-1,88	-9,92
IBERSOL	8,060	-0,25	-20,40
J MARTINS	10,150	0,15	-37,33
MOTA ENGIL	1,652	3,64	-54,90
NAVIGATOR	3,496	2,10	-17,16
NOS	5,290	0,76	-3,48
NOVABASE	2,240	-2,18	-26,53
PHAROL	0,179	-1,11	-28,48
REN	2,418	-1,06	-2,46
SEMAPA	12,660	-0,94	-28,86
SONAE CAP.	0,897	-0,22	1,13
SONAE SGPS	0,810	1,76	-28,11

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	3,64
NAVIGATOR	2,10
SONAE SGPS	1,76
NOS	0,76
ALTRI	0,73
PHAROL	-1,11
BCP	-1,60
GALP	-1,88
NOVABASE	-2,18
EDP	-2,51



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.702,63	-0,59%	-12,73%	5.801,45	4.686,25
CAC40	4.754,08	-0,95%	-10,51%	5.657,44	4.732,02
ESTX 50 PR	3.040,13	-0,77%	-13,24%	3.687,22	3.007,53
XTRA DAX	10.740,89	-0,29%	-16,85%	13.596,89	10.585,77
S&P 500	2.561,44	0,58%	-4,22%	2.940,91	2.530,54
IBEX 35	8.700,80	-1,27%	-13,37%	10.643,40	8.627,60
NIKKEI 225	21.115,45	-1,82%	-7,25%	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.