

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

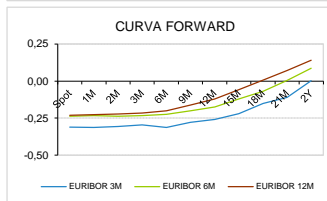
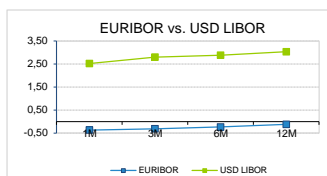
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

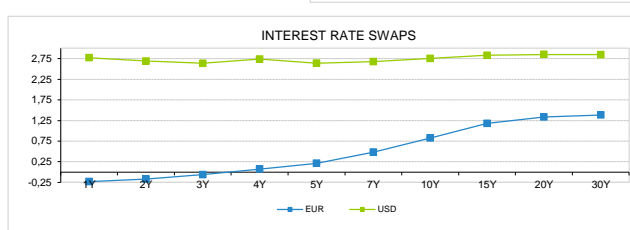
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3640	0	0	1M	2,5224	2	17	0,7304	-0,8132
3M	-0,3100	0	1	3M	2,8030	-1	10	0,9033	-0,7232
6M	-0,2360	0	2	6M	2,8830	-1	0	1,0332	-0,6502
12M	-0,1190	0	3	12M	3,0324	-2	-10	1,1680	-0,5040

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2315	0	1	-0,1209	0,4555	1,0513
2Y	-0,1720	-1	-3	0,0085	0,6085	1,1685
3Y	-0,0640	-2	-7	0,1570	0,7575	1,2807
4Y	0,0720	-2	-8	0,3071	0,8835	1,3720
5Y	0,2120	-2	-9	0,4533	1,0093	1,4570
7Y	0,4830	-1	-9	0,7155	1,2088	1,5922
10Y	0,8240	-1	-8	1,0227	1,4130	1,6990
15Y	1,1790	0	-8	1,3091	1,5689	1,7550
20Y	1,3330	0	-9	1,4268	1,6067	1,7210
30Y	1,3850	0	-9	1,4453	1,5608	1,6311

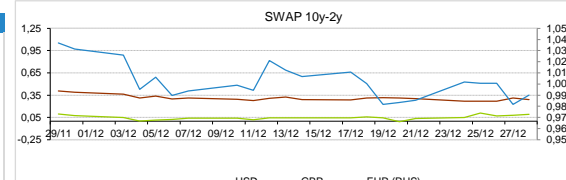
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



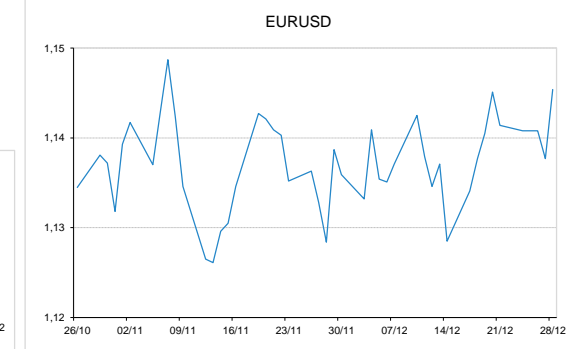
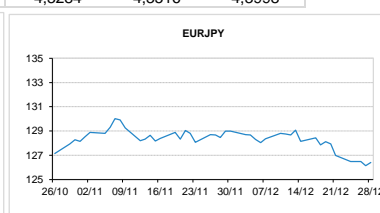
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7700	-8	-15	2,6236	2,5705	2,7315
2Y	2,6890	-5	-33	2,5455	2,6471	2,7675
3Y	2,6350	-14	-40	2,5510	2,6520	2,8235
4Y	2,7390	0	-27	2,5740	2,6960	2,8843
5Y	2,6390	-12	-41	2,6314	2,7285	2,9220
7Y	2,6760	-10	-40	2,6710	2,8040	2,9220
10Y	2,7520	-9	-38	2,7977	2,8640	2,9485
15Y	2,8290	-8	-38	2,8478	2,9110	2,9590
20Y	2,8510	-8	-38	2,8640	2,9080	2,9415
30Y	2,8440	-8	-37	2,8580	2,8825	2,8980



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	52,02	-0,14	-7,07	OT 2Y	-0,350	0,00	-15,00
JETFUEL	548,50	-7,25	-74,75	OT 5Y	0,459	0,05	-18,70
DIESEL	508,50	-7,93	-76,50	OT 10Y	1,723	0,04	-14,80
COBRE	5.972,00	31,00	-135,00	BUND 10Y	-0,261	1,61	-13,00
ZINCO	2.510,00	22,00	54,50	SCHATZ 2Y	0,028	0,46	-3,90
OURO	1.278,02	0,50	56,73	T-NOTE 10Y	3,431	-0,66	-24,90
TRIGO	512,50	2,00	1,00	T-NOTE 2Y	2,852	-0,39	-29,70
LICENÇA C02	25,05	0,04	5,41	GILT 10Y	1,490	-3,26	-8,60


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1454	0,68%	1,51%	1,1543	1,1633	1,1819
EUR/GBP	0,90273	-0,22%	-2,25%	0,9057	0,9089	0,9158
EUR/JPY	126,4	-0,21%	1,64%	126,40	126,40	126,40
EUR/CHF	1,1262	0,31%	0,28%	1,1252	1,1240	1,1216
EUR/BRL	4,4299	0,16%	-1,00%	4,4934	4,5598	4,6992
EUR/PLN	4,3046	-0,18%	-0,42%	4,3284	4,3516	4,3998

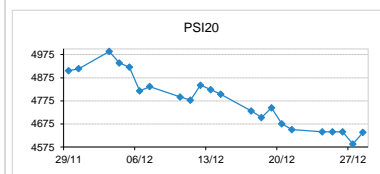

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1454	0,9027	126,40	1,1262	10,2632	7,4676	1,5579	1,62397	4,4299	9,9805
USD	0,8745	-	0,7885	110,435	0,9833	8,9784	6,5293	1,3637	1,4214	3,8682	8,7306

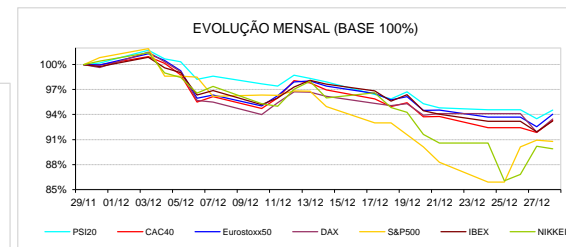
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,630	2,74	8,88
BCP	0,227	2,53	-16,62
CORT. AMORIM	8,700	2,59	-14,75
CTT	2,896	-1,30	-17,42
EDP	2,967	1,61	2,84
EDP R	7,570	0,13	8,66
GALP	13,625	1,08	-11,09
IBERSOL	7,800	-1,02	-22,96
J MARTINS	10,185	0,64	-37,11
MOTA ENGIL	1,562	3,45	-57,47
NAVIGATOR	3,532	1,79	-16,31
NOS	5,145	0,88	-6,13
NOVABASE	2,050	-1,91	-32,76
PHAROL	0,159	-4,79	-36,40
REN	2,402	0,08	-3,11
SEMAPA	12,720	-1,85	-28,52
SONAE CAP.	0,851	0,00	-4,06
SONAE SGPS	0,797	1,59	-29,26

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	3,45
ALTRI	2,74
CORT. AMORIM	2,59
BCP	2,53
NAVIGATOR	1,79
IBERSOL	-1,02
CTT	-1,30
SEMAPA	-1,85
NOVABASE	-1,91
PHAROL	-4,79



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.638,31	1,11%	-13,92%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.671,76	1,59%	-12,06%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	2.984,48	1,60%	-14,83%	3.687,22	2.908,70
XTRA DAX	10.558,96	1,71%	-18,26%	13.596,89	10.279,20
S&P 500	2.485,12	-0,14%	-7,04%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	8.481,30	1,43%	-15,54%	10.643,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.014,77	-0,31%	-12,08%	24.448,07	18.948,58



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.