

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

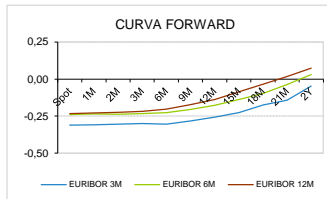
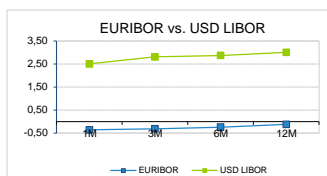
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

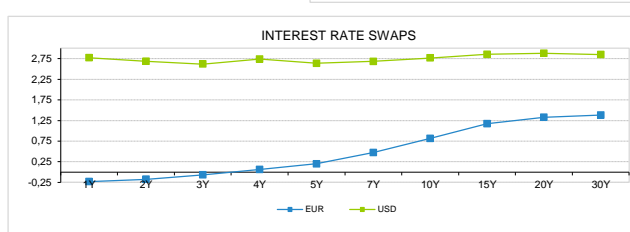
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3620	0	1	1M	2,5027	-2	16	0,7303	-0,7968
3M	-0,3100	0	1	3M	2,8076	1	7	0,9124	-0,7134
6M	-0,2380	0	1	6M	2,8756	0	-2	1,0347	-0,6322
12M	-0,1210	0	3	12M	3,0054	-1	-11	1,1703	-0,5026

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2328	0	0	-0,1380	0,3690	0,9545
2Y	-0,1750	0	-3	-0,0320	0,5200	1,0745
3Y	-0,0690	-1	-6	0,1020	0,6645	1,1860
4Y	0,0630	-1	-9	0,2440	0,7955	1,2845
5Y	0,2000	-1	-9	0,3860	0,9165	1,3675
7Y	0,4710	-1	-9	0,6430	1,1210	1,5113
10Y	0,8140	-1	-8	0,9510	1,3342	1,6225
15Y	1,1710	-1	-8	1,2443	1,5003	1,6820
20Y	1,3270	-1	-9	1,3615	1,5370	1,6520
30Y	1,3800	-1	-9	1,3817	1,4940	1,5657

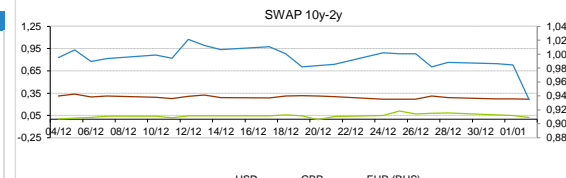
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



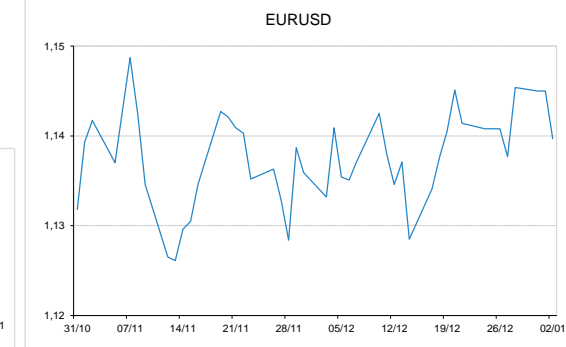
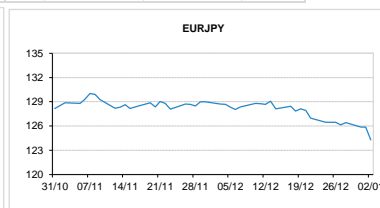
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7700	1	-14	2,5832	2,4750	2,6285
2Y	2,6830	1	-30	2,4919	2,5040	2,6810
3Y	2,6180	-1	-37	2,5065	2,5708	2,7210
4Y	2,7390	0	-27	2,5178	2,6171	2,7949
5Y	2,6350	-2	-40	2,5471	2,6300	2,8322
7Y	2,6810	-1	-37	2,5785	2,7365	2,8600
10Y	2,7660	1	-35	2,6925	2,7825	2,9145
15Y	2,8520	2	-33	2,7935	2,8355	2,8820
20Y	2,8780	2	-32	2,7960	2,8395	2,8795
30Y	2,8490	-3	-30	2,7930	2,8190	2,8370



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	55,61	1,81	-3,97	OT 2Y	-0,347	0,00	-10,90
JETFUEL	557,80	1,37	-47,36	OT 5Y	0,454	0,00	-12,40
DIESEL	517,55	1,87	-48,11	OT 10Y	1,713	-0,01	-9,10
COBRE	5.912,00	-32,00	-233,50	BUND 10Y	-0,341	-7,87	-16,40
ZINCO	2.482,50	25,50	-82,50	SCHATZ 2Y	0,016	-1,15	-3,20
OURO	1.285,18	4,66	64,50	T-NOTE 10Y	3,373	-1,32	-27,10
TRIGO	508,50	5,25	-7,25	T-NOTE 2Y	2,832	1,95	-34,10
LICENÇA C02	25,25	0,24	4,41	GILT 10Y	1,438	-5,83	-7,90


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1397	-0,46%	0,57%	1,1485	1,1576	1,1761
EUR/GBP	0,90165	-0,79%	-1,13%	0,9047	0,9079	0,9147
EUR/JPY	124,28	1,26%	3,56%	124,28	124,28	124,28
EUR/CHF	1,1224	0,35%	0,97%	1,1213	1,1202	1,1179
EUR/BRL	4,3296	2,71%	0,72%	4,3941	4,4629	4,5982
EUR/PLN	4,2926	0,15%	-0,38%	4,3162	4,3398	4,3879

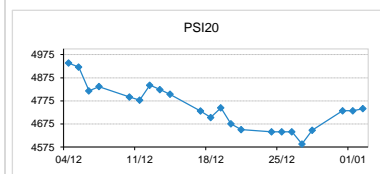

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1397	0,9017	124,28	1,1224	10,2148	7,4672	1,5437	1,62258	4,3296	9,8811
USD	0,8807	-	0,7935	109,305	0,9885	8,9867	6,5767	1,3602	1,4287	3,8165	8,6917

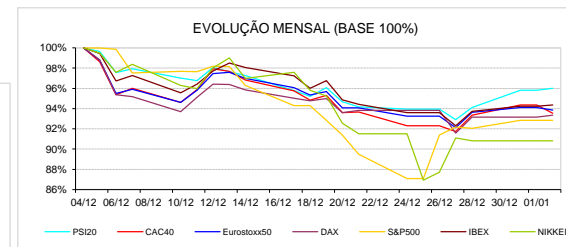
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	5,950	2,59	2,59
BCP	0,229	-0,39	-0,39
CORT. AMORIM	9,050	0,56	0,56
CTT	2,964	0,61	0,61
EDP	3,000	-1,61	-1,61
EDP R	7,810	0,45	0,45
GALP	14,060	1,92	1,92
IBERSOL	8,000	1,27	1,27
J MARTINS	10,300	-0,39	-0,39
MOTA ENGIL	1,614	0,25	0,25
NAVIGATOR	3,638	1,06	1,06
NOS	5,285	-0,19	-0,19
NOVABASE	2,060	1,98	1,98
PHAROL	0,166	1,72	1,72
REN	2,448	0,58	0,58
SEMAPA	12,940	-1,22	-1,22
SONAE CAP.	0,867	2,12	2,12
SONAE SGPS	0,813	0,31	0,31

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	2,59
SONAE CAP.	2,12
NOVABASE	1,98
GALP	1,92
PHAROL	1,72
NOS	-0,19
J MARTINS	-0,39
BCP	-0,39
SEMAPA	-1,22
EDP	-1,61



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.740,85	0,20%	0,20%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.689,39	-0,87%	-0,87%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	2.993,18	-0,27%	-0,27%	3.687,22	2.908,70
XTRA DAX	10.580,19	0,20%	0,20%	13.596,89	10.279,20
S&P 500	2.507,99	0,00%	0,00%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	8.550,00	0,12%	0,12%	10.643,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.014,77	-0,31%	0,00%	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.