

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

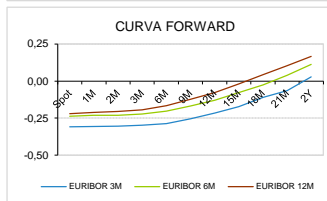
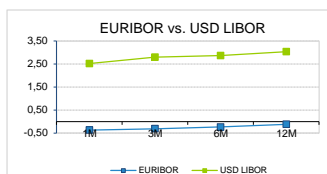
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENDA FIXA**

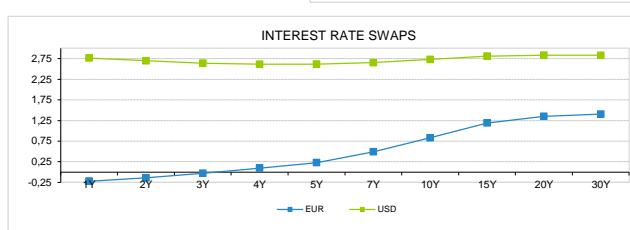
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3640	0	0	1M	2,5188	0	12	0,7319	-0,7798
3M	-0,3080	0	1	3M	2,7989	2	3	0,9042	-0,7026
6M	-0,2360	0	1	6M	2,8698	2	-2	1,0319	-0,6320
12M	-0,1180	0	2	12M	3,0390	2	-6	1,1824	-0,4906

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2200	0	1	-0,0794	0,4450	1,0070
2Y	-0,1410	1	0	0,0440	0,5875	1,1330
3Y	-0,0300	2	-1	0,1775	0,7270	1,2480
4Y	0,0970	2	-3	0,3150	0,8590	1,3510
5Y	0,2300	2	-3	0,4520	0,9810	1,4390
7Y	0,4900	2	-4	0,7090	1,1890	1,5846
10Y	0,8310	2	-3	1,0203	1,4058	1,7040
15Y	1,1910	2	-2	1,3172	1,5755	1,7690
20Y	1,3490	2	-2	1,4410	1,6197	1,7390
30Y	1,4040	2	-2	1,4654	1,5800	1,6540

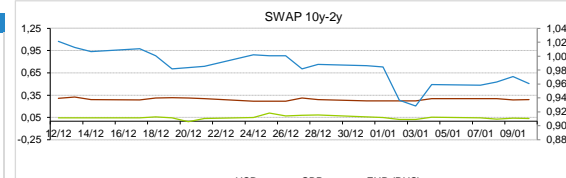
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



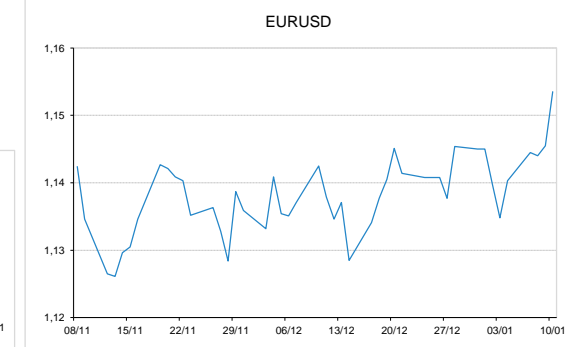
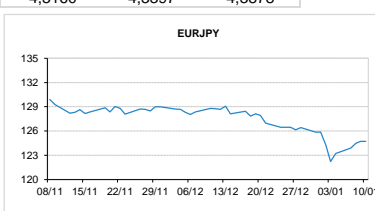
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7640	1	-12	2,6402	2,5425	2,6885
2Y	2,6970	4	-21	2,5550	2,5780	2,7290
3Y	2,6390	5	-25	2,5170	2,6150	2,7645
4Y	2,6130	5	-26	2,5490	2,6540	2,8050
5Y	2,6150	5	-26	2,5610	2,6890	2,8674
7Y	2,6510	5	-24	2,6260	2,7405	2,8750
10Y	2,7280	4	-23	2,7375	2,8255	2,9040
15Y	2,8110	4	-22	2,8055	2,8620	2,9005
20Y	2,8340	4	-22	2,8240	2,8610	2,8970
30Y	2,8290	3	-22	2,8165	2,8360	2,8550



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	61,49	0,05	1,39	OT 2Y	-0,182	0,01	9,80
JETFUEL	617,25	9,00	9,20	OT 5Y	0,474	-0,05	-4,40
DIESEL	574,13	10,13	7,83	OT 10Y	1,716	-0,06	-4,10
COBRE	5.963,50	52,00	-187,00	BUND 10Y	-0,313	-1,97	-5,50
ZINCO	2.510,50	-5,50	-96,50	SCHATZ 2Y	0,032	-0,69	-1,80
OURO	1.288,45	-1,54	44,97	T-NOTE 10Y	3,409	-0,82	-14,60
TRIGO	514,75	-5,25	-10,50	T-NOTE 2Y	2,883	-1,17	-18,40
LICENÇA C02	22,11	0,08	0,90	GILT 10Y	1,504	3,06	9,50


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1535	0,70%	0,96%	1,1625	1,1716	1,1902
EUR/GBP	0,90423	-0,56%	-0,20%	0,9072	0,9103	0,9172
EUR/JPY	124,7	0,00%	3,28%	124,70	124,70	124,70
EUR/CHF	1,1303	-0,43%	-0,49%	1,1293	1,1282	1,1258
EUR/BRL	4,2604	-0,41%	4,41%	4,3217	4,3869	4,5251
EUR/PLN	4,2923	0,15%	0,08%	4,3160	4,3397	4,3878

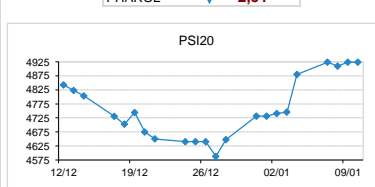

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1535	0,9042	124,70	1,1303	10,2324	7,4650	1,5241	1,60192	4,2604	9,7502
USD	0,8679	-	0,7826	108,19	0,9804	8,8842	6,4791	1,3230	1,3911	3,6832	8,4629

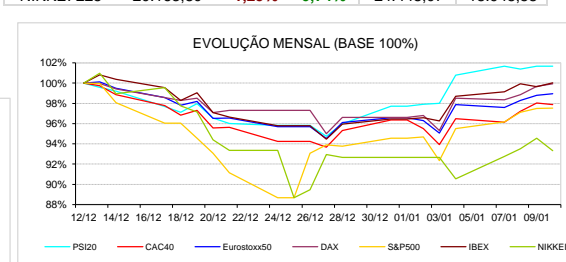
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,230	0,48	7,41
BCP	0,245	0,12	6,93
CORT. AMORIM	9,480	1,07	5,33
CTT	3,048	-0,97	3,46
EDP	3,062	-0,42	0,43
EDP R	7,860	1,03	1,09
GALP	14,495	-0,55	5,07
IBERSOL	8,660	2,85	9,62
J MARTINS	10,680	0,00	3,29
MOTA ENGIL	1,722	0,00	6,96
NAVIGATOR	3,808	0,95	5,78
NOS	5,395	-0,92	1,89
NOVABASE	2,070	0,00	2,48
PHAROL	0,187	-2,91	14,58
REN	2,540	-0,39	4,35
SEMAPA	14,320	-0,14	9,31
SONAE CAP.	0,862	-1,49	1,53
SONAE SGPS	0,846	2,24	4,38

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	2,85
SONAE SGPS	2,24
CORT. AMORIM	1,07
EDP R	1,03
NAVIGATOR	0,95
GALP	-0,55
NOS	-0,92
CTT	-0,97
SONAE CAP.	-1,49
PHAROL	-2,91



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.923,75	0,00%	4,06%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.805,66	-0,16%	1,58%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.075,73	0,18%	2,48%	3.687,22	2.908,70
XTRA DAX	10.921,59	0,26%	3,43%	13.596,89	10.279,20
S&P 500	2.586,03	0,02%	3,14%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	8.856,80	0,38%	3,71%	10.643,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.163,80	-1,29%	0,74%	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.