

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

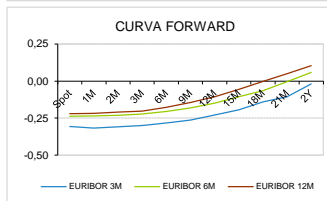
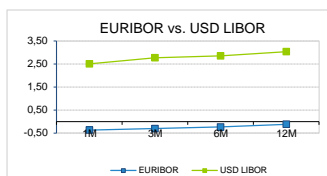
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

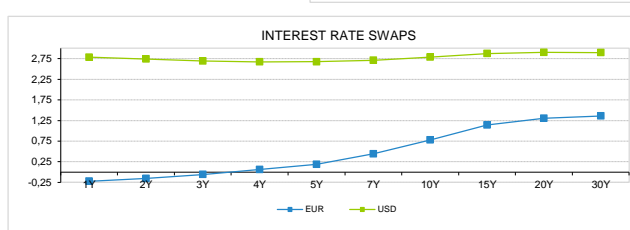
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,5100	-1	0	0,7335	-0,7824
3M	-0,3060	0	0	3M	2,7706	-1	-5	0,9191	-0,7024
6M	-0,2360	0	0	6M	2,8536	0	-5	1,0403	-0,6440
12M	-0,1150	0	0	12M	3,0350	0	-4	1,1709	-0,5082

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,2209	0	1	-0,1063	0,3444	0,8971	
2Y	-0,1560	-1	0	-0,0096	0,4831	1,0085	
3Y	-0,0570	-1	-1	0,1175	0,6166	1,1199	
4Y	0,0620	-1	-3	0,2473	0,7447	1,2181	
5Y	0,1880	-2	-4	0,3752	0,8641	1,3080	
7Y	0,4430	-2	-5	0,6145	1,0680	1,4480	
10Y	0,7780	-2	-5	0,9165	1,2871	1,5774	
15Y	1,1410	-2	-4	1,2097	1,4576	1,6498	
20Y	1,3030	-2	-3	1,3352	1,5069	1,6243	
30Y	1,3620	-2	-2	1,3604	1,4680	1,5390	

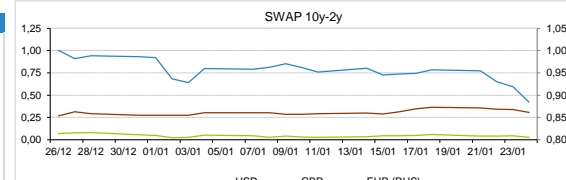
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



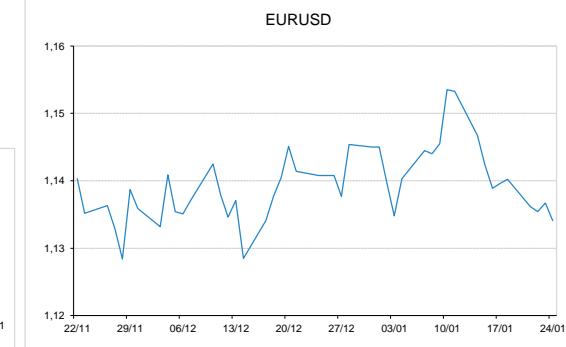
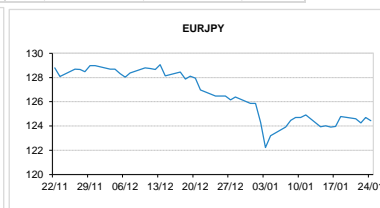
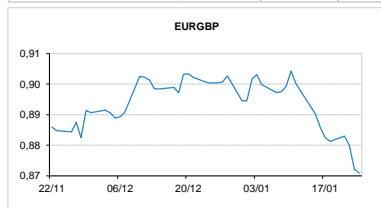
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7830	-1	-7	2,6562	2,5205	2,6875
2Y	2,7420	-3	-8	2,5620	2,5791	2,7310
3Y	2,6920	-3	-8	2,5480	2,6231	2,7720
4Y	2,6710	-3	-7	2,5590	2,6410	2,8335
5Y	2,6740	-3	-8	2,6098	2,6825	2,8670
7Y	2,7100	-3	-7	2,6470	2,7775	2,9180
10Y	2,7860	-3	-6	2,7599	2,8300	2,9502
15Y	2,8730	-3	-4	2,8150	2,8710	2,9280
20Y	2,8990	-2	-3	2,8385	2,8730	2,9110
30Y	2,8950	-2	-3	2,8280	2,8766	2,8977



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	61,27	0,13	10,50	OT 2Y	-0,187	-0,01	16,10
JETFUEL	607,34	1,09	51,59	OT 5Y	0,477	-0,05	6,50
DIESEL	572,34	1,43	55,91	OT 10Y	1,651	-0,06	-3,60
COBRE	5.942,00	16,50	-39,50	BUND 10Y	-0,398	-6,02	-14,90
ZINCO	2.639,00	40,50	128,50	SCHATZ 2Y	0,041	-0,23	-0,70
OURO	1.280,47	-4,30	12,12	T-NOTE 10Y	3,414	-3,80	-3,70
TRIGO	523,50	-2,50	7,00	T-NOTE 2Y	2,901	-2,93	1,40
LICENÇA C02	24,07	-0,65	-1,11	GILT 10Y	1,486	-6,15	0,90


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1341	-0,23%	-0,59%	1,1429	1,1519	1,1705
EUR/GBP	0,87085	0,15%	3,39%	0,8736	0,8766	0,8832
EUR/JPY	124,43	0,22%	1,64%	124,43	124,43	124,43
EUR/CHF	1,1263	0,59%	0,11%	1,1252	1,1241	1,1217
EUR/BRL	4,2572	0,48%	4,51%	4,3171	4,3830	4,5153
EUR/PLN	4,2929	-0,02%	-0,28%	4,3153	4,3385	4,3859

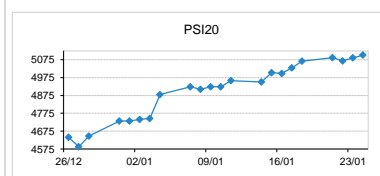

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1341	0,8709	124,43	1,1263	10,2762	7,4658	1,5088	1,59431	4,2572	9,7122
USD	0,8807	-	0,7666	109,58	0,9948	9,0570	6,5757	1,3342	1,4078	3,7622	8,5616

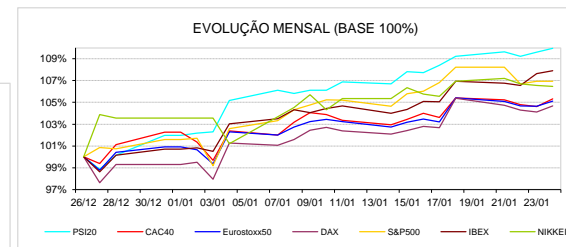
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,010	-0,85	20,86
BCP	0,242	-0,21	5,23
CORT. AMORIM	9,580	-0,52	6,44
CTT	3,136	0,58	6,45
EDP	3,053	0,16	0,13
EDP R	7,885	0,00	1,41
GALP	13,970	0,50	1,27
IBERSOL	8,500	-2,07	7,59
J MARTINS	12,530	-1,96	21,18
MOTA ENGIL	1,966	11,96	22,11
NAVIGATOR	4,146	-0,34	15,17
NOS	5,650	2,63	6,70
NOVABASE	2,290	1,33	13,37
PHAROL	0,180	-1,21	10,05
REN	2,554	0,31	4,93
SEMAPA	15,100	-0,13	15,27
SONAE CAP.	0,873	-0,11	2,83
SONAE SGPS	0,949	2,32	17,10

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	11,96
NOS	2,63
SONAE SGPS	2,32
NOVABASE	1,33
CTT	0,58
CORT. AMORIM	-0,52
ALTRI	-0,85
PHAROL	-1,21
J MARTINS	-1,96
IBERSOL	-2,07



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.101,73	0,31%	7,83%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.871,96	0,65%	2,99%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.126,31	0,46%	4,16%	3.674,50	2.908,70
XTRA DAX	11.130,18	0,53%	5,41%	13.576,84	10.279,20
S&P 500	2.638,69	0,00%	5,26%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.150,00	0,23%	7,14%	10.635,10	8.286,20
NIKKEI 225	20.574,63	-0,09%	2,80%	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.