

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

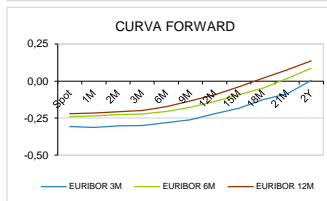
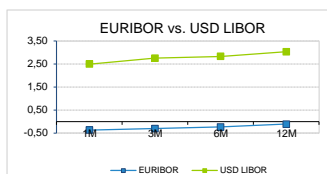
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

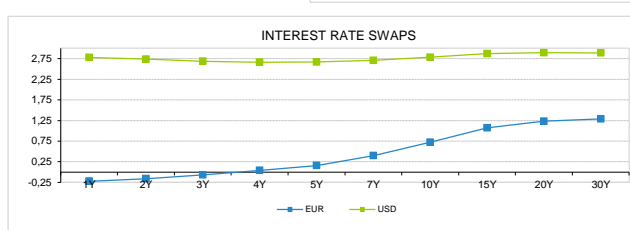
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,5000	0	-1	0,7336	-0,7792
3M	-0,3070	0	0	3M	2,7516	-1	-6	0,9194	-0,6988
6M	-0,2370	0	0	6M	2,8323	-2	-6	1,0448	-0,6424
12M	-0,1120	0	1	12M	3,0315	0	-2	1,1736	-0,5102

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2205	0	1	-0,0943	0,3563	0,9130
2Y	-0,1590	0	0	0,0076	0,5050	1,0310
3Y	-0,0660	0	-2	0,1440	0,6663	1,1400
4Y	0,0430	-1	-5	0,2711	0,7693	1,2390
5Y	0,1600	-1	-7	0,3991	0,8874	1,3260
7Y	0,3990	-2	-10	0,6388	1,0901	1,4630
10Y	0,7210	-3	-11	0,9356	1,2989	1,5910
15Y	1,0730	-4	-11	1,2252	1,4704	1,6610
20Y	1,2340	-4	-10	1,3486	1,5179	1,6350
30Y	1,2910	-5	-9	1,3721	1,4790	1,5471

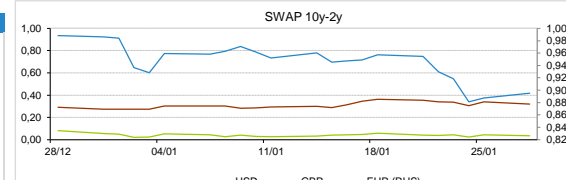
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



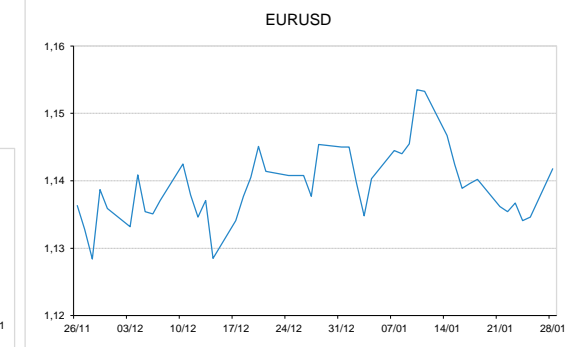
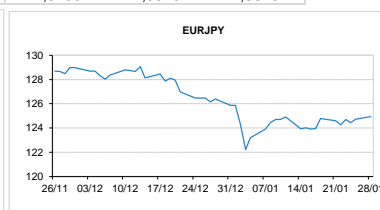
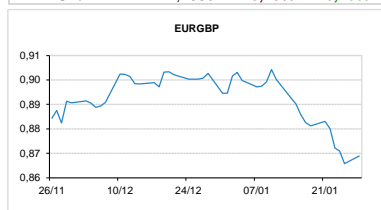
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7780	1	-7	2,7025	2,5390	2,7160
2Y	2,7390	2	0	2,5920	2,5920	2,7515
3Y	2,6880	3	-8	2,5750	2,6265	2,7910
4Y	2,6640	3	-8	2,5890	2,6700	2,8300
5Y	2,6690	4	-9	2,6135	2,7055	2,8871
7Y	2,7060	4	-7	2,6710	2,8007	2,9110
10Y	2,7830	4	-6	2,7640	2,8520	2,9410
15Y	2,8690	3	-4	2,8380	2,8910	2,9440
20Y	2,8940	3	-4	2,8565	2,8905	2,9275
30Y	2,8900	3	-3	2,8480	2,8690	2,8900



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	59,71	-1,93	6,50	OT 2Y	-0,181	0,00	16,60
JETFUEL	595,50	-12,41	57,50	OT 5Y	0,469	-0,01	5,80
DIESEL	558,50	-14,16	61,00	OT 10Y	1,648	0,00	-3,60
COBRE	6.079,00	134,00	100,50	BUND 10Y	-0,367	0,65	-9,10
ZINCO	2.691,50	33,00	207,50	SCHATZ 2Y	0,044	0,00	2,10
OURO	1.303,56	5,85	24,57	T-NOTE 10Y	3,432	-1,82	-0,50
TRIGO	518,50	-1,50	7,00	T-NOTE 2Y	2,922	-1,56	6,60
LICENÇA C02	22,78	-1,15	-2,20	GILT 10Y	1,497	-3,65	-2,50


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1418	0,63%	-0,31%	1,1506	1,1597	1,1786
EUR/GBP	0,8688	-0,35%	3,90%	0,8715	0,8745	0,8811
EUR/JPY	124,94	-0,18%	1,17%	124,94	124,94	124,94
EUR/CHF	1,1334	-0,05%	-0,67%	1,1324	1,1311	1,1288
EUR/BRL	4,3064	-0,01%	3,02%	4,3643	4,4275	4,5672
EUR/PLN	4,2930	-0,15%	0,18%	4,3150	4,3378	4,3846

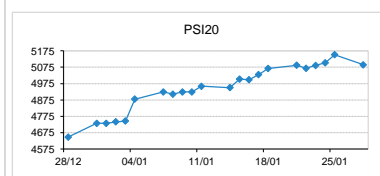

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1418	0,8689	124,94	1,1334	10,3573	7,4654	1,5168	1,59581	4,3064	9,7380
USD	0,8745	-	0,7601	109,285	0,9914	9,0557	6,5283	1,3259	1,3952	3,7678	8,5142

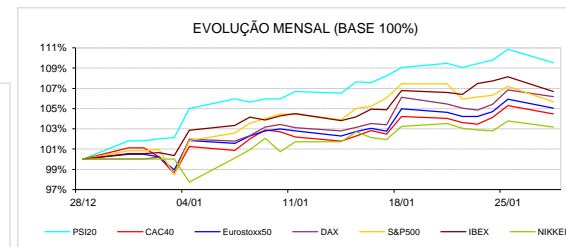
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,000	-1,96	20,69
BCP	0,243	-0,33	5,97
CORT. AMORIM	9,590	-1,74	6,56
CTT	3,108	-1,71	5,50
EDP	3,088	-0,23	1,28
EDP R	7,850	0,00	0,96
GALP	13,540	-2,94	-1,85
IBERSOL	8,400	-1,18	6,33
J MARTINS	12,545	-1,38	21,32
MOTA ENGIL	1,952	-4,08	21,24
NAVIGATOR	4,144	-2,26	15,11
NOS	5,680	-0,53	7,27
NOVABASE	2,260	-1,74	11,88
PHAROL	0,180	0,33	10,29
REN	2,576	0,23	5,83
SEMAPA	14,900	-2,10	13,74
SONAE CAP.	0,879	0,11	3,53
SONAE SGPS	0,930	-2,26	14,75

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	0,33
REN	0,23
SONAE CAP.	0,11
SEMAPA	-2,10
SONAE SGPS	-2,26
NAVIGATOR	-2,26
GALP	-2,94
MOTA ENGIL	-4,08



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.089,92	-1,21%	7,58%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.888,58	-0,76%	3,34%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.137,27	-0,82%	4,53%	3.652,48	2.908,70
XTRA DAX	11.210,31	-0,63%	6,17%	13.370,02	10.279,20
S&P 500	2.627,61	-1,42%	4,79%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.062,40	-1,34%	6,12%	10.635,10	8.286,20
NIKKEI 225	20.649,00	-0,60%	3,17%	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.