

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

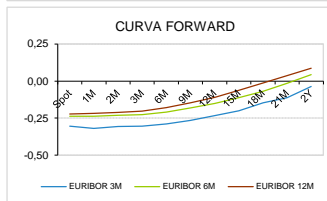
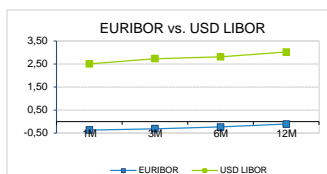
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

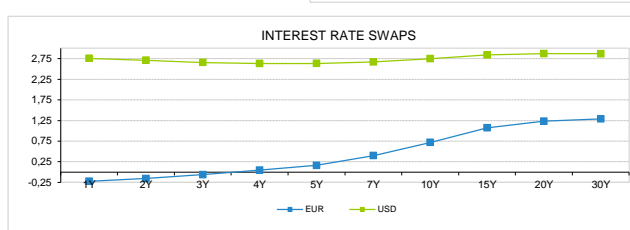
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	-1	1M	2,5091	1	-1	0,7325	-0,7872
3M	-0,3080	0	0	3M	2,7363	-1	-6	0,9241	-0,7054
6M	-0,2360	0	0	6M	2,8115	-1	-6	1,0353	-0,6464
12M	-0,1090	0	1	12M	3,0206	0	1	1,1644	-0,5114

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2225	0	1	-0,1120	0,3165	0,8035
2Y	-0,1570	0	2	-0,0114	0,4390	0,9170
3Y	-0,0630	-1	1	0,0983	0,5610	1,0270
4Y	0,0450	-1	-2	0,2139	0,6770	1,1260
5Y	0,1620	-1	-4	0,3315	0,7895	1,2130
7Y	0,3980	-2	-7	0,5585	0,9885	1,3610
10Y	0,7180	-2	-10	0,8500	1,2029	1,4860
15Y	1,0710	-2	-10	1,1416	1,3798	1,5600
20Y	1,2330	-2	-9	1,2623	1,4239	1,5380
30Y	1,2900	-2	-9	1,2868	1,3870	1,4535

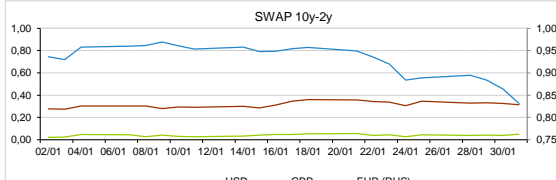
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



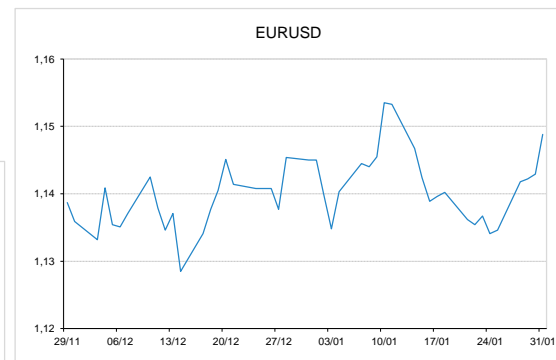
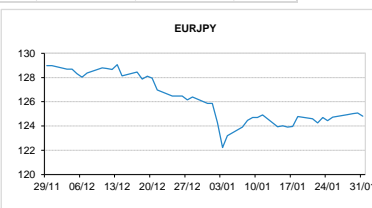
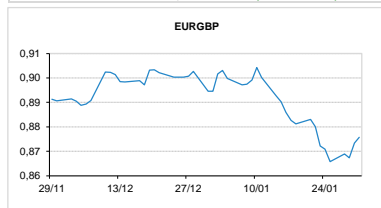
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7560	-1	0	2,5480	2,4370	2,6335
2Y	2,7090	-3	3	2,4495	2,4995	2,6946
3Y	2,6570	-3	3	2,4460	2,5370	2,7075
4Y	2,6310	-3	-11	2,4690	2,5760	2,7480
5Y	2,6340	-3	0	2,4990	2,6180	2,8101
7Y	2,6700	-3	-1	2,5665	2,6950	2,8410
10Y	2,7500	-2	-2	2,6735	2,7790	2,8770
15Y	2,8410	-2	-1	2,7510	2,8240	2,8840
20Y	2,8690	-1	-1	2,7780	2,8290	2,8950
30Y	2,8680	-1	-1	2,7850	2,8030	2,8280



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,17	0,52	8,37	OT 2Y	-0,208	-0,02	14,20
JETFUEL	619,50	5,75	81,50	OT 5Y	0,428	-0,04	-2,90
DIESEL	583,25	6,50	85,75	OT 10Y	1,620	-0,05	-10,20
COBRE	6.133,00	86,00	139,00	BUND 10Y	-0,419	-3,68	-15,60
ZINCO	2.702,50	31,50	252,50	SCHATZ 2Y	0,057	-0,23	2,90
OURO	1.321,52	10,34	39,94	T-NOTE 10Y	3,342	-4,60	-4,40
TRIGO	515,75	-1,00	12,50	T-NOTE 2Y	2,821	-4,87	0,80
LICENÇA C02	22,31	-0,75	-2,70	GILT 10Y	1,455	-3,82	-4,20


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1488	0,52%	0,33%	1,1578	1,1667	1,1851
EUR/GBP	0,87578	-0,27%	2,14%	0,8786	0,8815	0,8878
EUR/JPY	124,81	0,22%	0,83%	124,81	124,81	124,81
EUR/CHF	1,1380	0,25%	-1,10%	1,1369	1,1357	1,1333
EUR/BRL	4,1764	1,25%	6,44%	4,2348	4,2974	4,4253
EUR/PLN	4,2617	0,64%	0,64%	4,2837	4,3058	4,3511

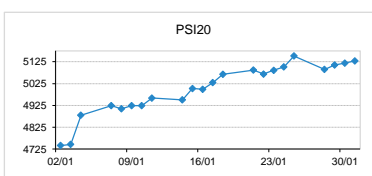

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1488	0,8758	124,81	1,1380	10,3613	7,4659	1,5050	1,57314	4,1764	9,6580
USD	0,8714	-	0,7602	108,805	0,9917	9,0414	6,5059	1,3134	1,3715	3,6419	8,4231

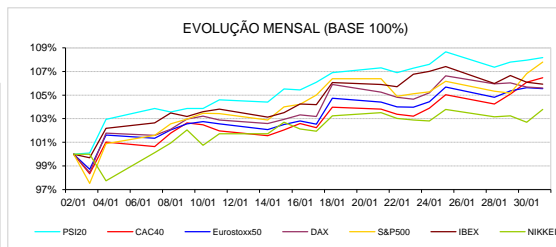
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,230	0,98	24,66
BCP	0,241	-1,19	5,01
CORT. AMORIM	9,750	0,52	8,33
CTT	3,146	0,90	6,79
EDP	3,190	1,11	4,62
EDP R	7,850	0,00	0,96
GALP	13,645	1,11	-1,09
IBERSOL	8,420	-0,47	6,58
J MARTINS	12,370	-0,64	19,63
MOTA ENGIL	1,930	-1,03	19,88
NAVIGATOR	4,274	-0,51	18,72
NOS	5,665	0,18	6,99
NOVABASE	2,170	-1,81	7,43
PHAROL	0,181	-1,09	10,91
REN	2,622	0,23	7,72
SEMAPA	15,260	1,73	16,49
SONAE CAP.	0,889	1,83	4,71
SONAE SGPS	0,912	0,44	12,53

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE CAP.	1,83
SEMAPA	1,73
GALP	1,11
EDP	1,11
ALTRI	0,98
J MARTINS	-0,64
MOTA ENGIL	-1,03
PHAROL	-1,09
BCP	-1,19
NOVABASE	-1,81



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.129,02	0,20%	8,40%	5.801,45	4.551,84
CAC40	4.992,72	0,36%	5,54%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.159,43	-0,07%	5,26%	3.636,22	2.908,70
XTRA DAX	11.173,10	-0,08%	5,82%	13.301,41	10.279,20
S&P 500	2.706,39	0,91%	7,93%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.056,70	-0,16%	6,05%	10.543,70	8.286,20
NIKKEI 225	20.773,49	1,06%	3,79%	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.