

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

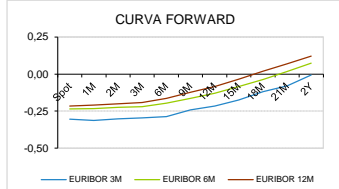
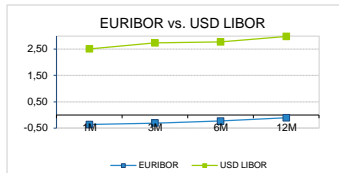
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

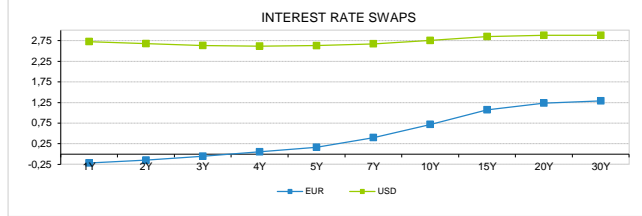
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,5123	0	-1	0,7313	-0,7840
3M	-0,3080	0	0	3M	2,7385	0	-7	0,9154	-0,7058
6M	-0,2340	0	0	6M	2,7775	-2	-8	1,0288	-0,6490
12M	-0,1080	0	1	12M	2,9858	1	2	1,1641	-0,5134

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,2160	0	1	-0,0842	0,3481	0,8358	
2Y	-0,1490	1	3	0,0192	0,4708	0,9534	
3Y	-0,0530	1	3	0,1290	0,5920	1,0653	
4Y	0,0530	1	2	0,2455	0,7103	1,1625	
5Y	0,1660	1	0	0,3618	0,8243	1,2450	
7Y	0,3990	2	-3	0,5917	1,0190	1,3944	
10Y	0,7180	2	-5	0,8810	1,2353	1,5230	
15Y	1,0720	2	-6	1,1738	1,4121	1,6000	
20Y	1,2350	2	-6	1,2990	1,4619	1,5770	
30Y	1,2910	1	-6	1,3217	1,4210	1,4870	

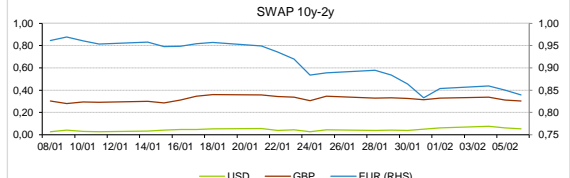
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



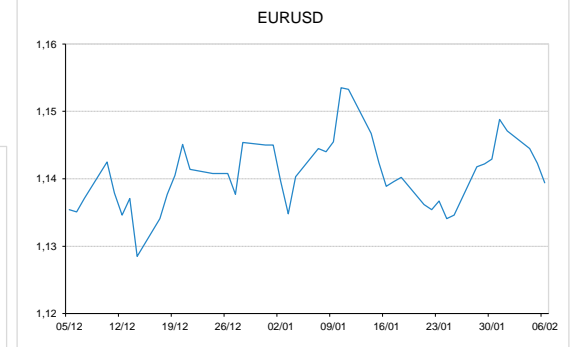
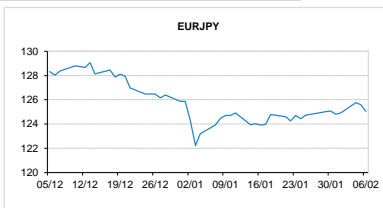
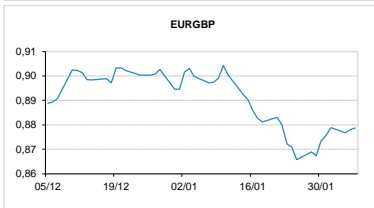
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7260	1	-3	2,6025	2,5175	2,6805
2Y	2,6760	2	3	2,5160	2,5410	2,7225
3Y	2,6320	3	6	2,5110	2,5890	2,7867
4Y	2,6170	3	-12	2,5320	2,6310	2,8220
5Y	2,6270	4	7	2,5610	2,6720	2,8587
7Y	2,6710	4	7	2,6270	2,7460	2,8850
10Y	2,7540	4	6	2,7190	2,8422	2,9431
15Y	2,8470	4	6	2,8020	2,8868	2,9220
20Y	2,8770	4	6	2,8260	2,8914	2,9045
30Y	2,8760	4	5	2,8438	2,8410	2,8620



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,55	0,57	5,34	OT 2Y	-0,210	0,00	1,60
JETFUEL	621,57	4,33	44,92	OT 5Y	0,465	0,00	-8,00
DIESEL	585,57	2,58	50,17	OT 10Y	1,662	0,00	-16,00
COBRE	6.223,00	65,00	315,00	BUND 10Y	-0,409	-0,50	-11,60
ZINCO	2.751,00	-67,00	301,00	SCHATZ 2Y	0,067	1,15	2,60
OURO	1.312,57	-2,38	28,10	T-NOTE 10Y	3,388	-1,32	0,50
TRIGO	525,75	-1,50	8,75	T-NOTE 2Y	2,869	-0,39	1,70
LICENÇA C02	23,73	0,56	0,00	GILT 10Y	1,448	-1,53	-2,40


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1394	-0,25%	-0,45%	1,1481	1,1572	1,1759
EUR/GBP	0,8787	-0,08%	2,11%	0,8814	0,8844	0,8908
EUR/JPY	125,05	0,43%	-0,92%	125,05	125,05	125,05
EUR/CHF	1,1391	0,19%	-1,26%	1,1380	1,1369	1,1345
EUR/BRL	4,2131	-0,65%	1,77%	4,2698	4,3352	4,4636
EUR/PLN	4,2970	-0,25%	-0,03%	4,3177	4,3403	4,3862

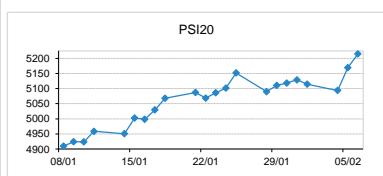

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1394	0,8787	125,05	1,1391	10,4398	7,4645	1,5011	1,59628	4,2131	9,7032
USD	0,8790	-	0,7715	109,815	1,0010	9,1712	6,5612	1,3176	1,4018	3,6987	8,5220

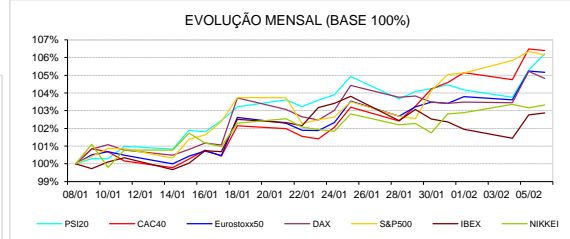
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,330	1,38	26,38
BCP	0,242	2,55	5,23
CORT. AMORIM	9,850	1,97	9,44
CTT	3,148	0,58	6,86
EDP	3,230	0,34	5,94
EDP R	7,880	0,38	1,35
GALP	14,240	-0,59	3,23
IBERSOL	8,200	0,24	3,80
J MARTINS	13,295	2,19	28,58
MOTA ENGIL	1,936	-0,31	20,25
NAVIGATOR	4,316	1,22	19,89
NOS	5,600	-0,36	5,76
NOVABASE	2,240	0,90	10,89
PHAROL	0,183	2,01	12,01
REN	2,634	1,23	8,22
SEMAPA	15,240	0,79	16,34
SONAE CAP.	0,906	0,89	6,71
SONAE SGPS	0,922	1,21	13,77

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	2,55
J MARTINS	2,19
PHAROL	2,01
CORT. AMORIM	1,97
ALTRI	1,38
MOTA ENGIL	-0,31
NOS	-0,36
GALP	-0,59



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.215,24	0,89%	10,22%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.079,05	-0,08%	7,36%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.212,75	-0,07%	7,04%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.324,72	-0,38%	7,25%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.732,57	-0,19%	9,00%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.100,90	0,10%	6,57%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.874,06	0,14%	4,29%	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.