

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

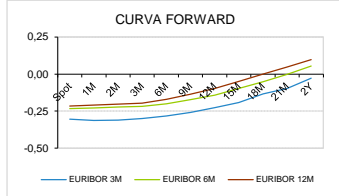
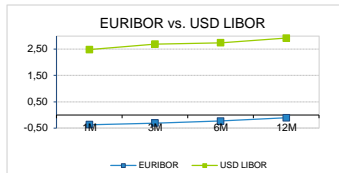
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENTA FIXA**

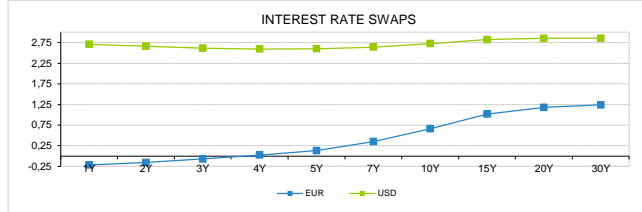
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4814	-1	-3	0,7295	-0,7780
3M	-0,3080	0	0	3M	2,6939	1	-9	0,8673	-0,7184
6M	-0,2320	0	0	6M	2,7440	0	-11	0,9898	-0,6518
12M	-0,1080	0	1	12M	2,9168	0	-9	1,1294	-0,5124

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2161	0	1	-0,0983	0,3246	0,7786
2Y	-0,1570	0	1	0,0006	0,4408	0,8900
3Y	-0,0720	1	-1	0,1078	0,5530	1,0016
4Y	0,0260	1	-3	0,2191	0,6649	1,1047
5Y	0,1310	1	-6	0,3297	0,7754	1,1949
7Y	0,3500	0	-10	0,5497	0,9751	1,3441
10Y	0,6630	0	-13	0,8421	1,1917	1,4836
15Y	1,0190	0	-14	1,1339	1,3703	1,5622
20Y	1,1800	0	-14	1,2607	1,4228	1,5433
30Y	1,2410	0	-15	1,2911	1,3915	1,4595

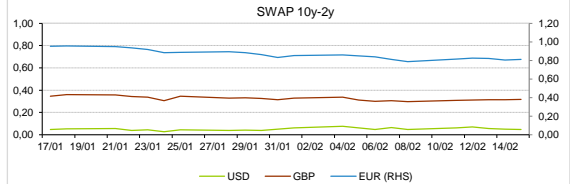
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



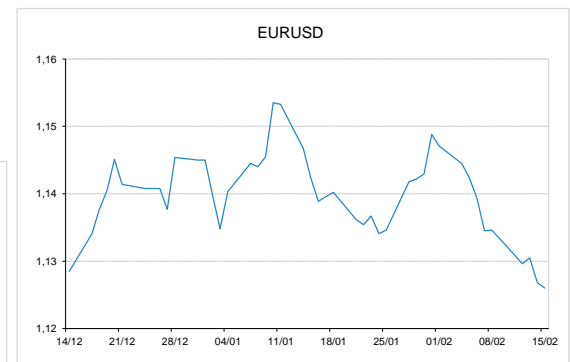
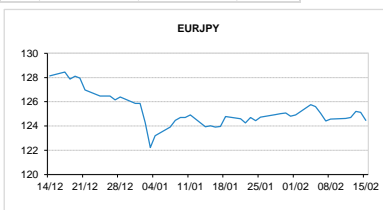
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7090	1	-6	2,6082	2,4805	2,6907
2Y	2,6630	2	-3	2,5525	2,5518	2,6870
3Y	2,6140	3	-1	2,5170	2,5973	2,7280
4Y	2,5950	2	-1	2,5150	2,6030	2,8015
5Y	2,6010	2	0	2,5520	2,6757	2,8373
7Y	2,6420	2	0	2,6035	2,7200	2,8605
10Y	2,7260	2	1	2,7306	2,7970	2,8940
15Y	2,8210	2	1	2,7845	2,8520	2,8930
20Y	2,8520	2	1	2,8170	2,8505	2,9229
30Y	2,8540	2	1	2,8337	2,8597	2,8410



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	65,83	1,26	5,05	OT 2Y	-0,234	-0,01	-12,30
JETFUEL	648,00	17,25	46,75	OT 5Y	0,363	-0,01	-22,40
DIESEL	619,00	18,50	59,25	OT 10Y	1,563	-0,01	-22,60
COBRE	6.137,00	12,00	240,00	BUND 10Y	-0,477	0,29	-13,80
ZINCO	2.589,00	-7,00	88,00	SCHATZ 2Y	0,060	-0,46	3,50
OURO	1.315,84	1,63	27,76	T-NOTE 10Y	3,381	1,15	-3,70
TRIGO	504,75	-5,75	-11,25	T-NOTE 2Y	2,881	1,75	-0,20
LICENÇA C02	20,38	0,60	-2,24	GILT 10Y	1,407	1,80	-13,50


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,126	-0,07%	-1,44%	1,1346	1,1435	1,1619
EUR/GBP	0,87938	0,01%	1,24%	0,8821	0,8850	0,8912
EUR/JPY	124,45	0,54%	-0,35%	124,45	124,45	124,45
EUR/CHF	1,1342	0,09%	-0,73%	1,1331	1,1321	1,1297
EUR/BRL	4,1831	0,43%	1,39%	4,2434	4,3095	4,4395
EUR/PLN	4,3290	0,16%	-0,80%	4,3507	4,3726	4,4179

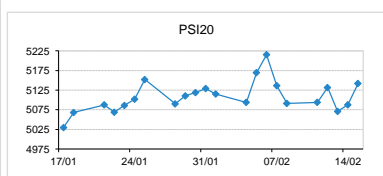

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1260	0,8794	124,45	1,1342	10,4649	7,4617	1,4959	1,58243	4,1831	9,7472
USD	0,8877	-	0,7785	110,535	1,0067	9,2914	6,6238	1,3281	1,4044	3,7187	8,6576

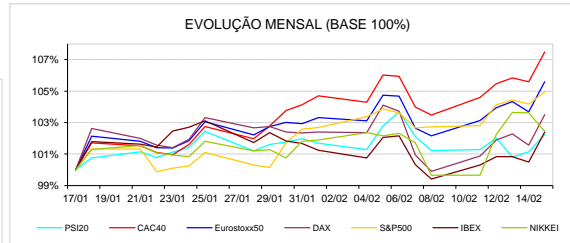
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,330	0,41	26,38
BCP	0,235	3,43	2,40
CORT. AMORIM	9,790	1,77	8,78
CTT	3,080	0,39	4,55
EDP	3,248	-0,37	6,53
EDP R	8,090	1,51	4,05
GALP	14,385	2,75	4,28
IBERSOL	8,100	3,05	2,53
J MARTINS	12,745	-0,16	23,26
MOTA ENGIL	1,886	0,96	17,14
NAVIGATOR	4,222	1,25	17,28
NOS	5,350	0,85	1,04
NOVABASE	2,480	16,43	22,77
PHAROL	0,181	0,67	10,91
REN	2,598	-0,15	6,74
SEMAPA	15,300	1,46	16,79
SONAE CAP.	0,895	0,00	5,42
SONAE SGPS	0,906	0,50	11,79

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
NOVABASE	16,43
BCP	3,43
IBERSOL	3,05
GALP	2,75
CORT. AMORIM	1,77
REN	-0,15
J MARTINS	-0,16
EDP	-0,37



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.141,96	1,07%	8,68%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.153,19	1,79%	8,93%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.241,25	1,84%	7,99%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.299,80	1,89%	7,02%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.766,47	0,76%	10,36%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.123,20	1,91%	6,83%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	20.900,63	-1,13%	4,43%	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.