

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

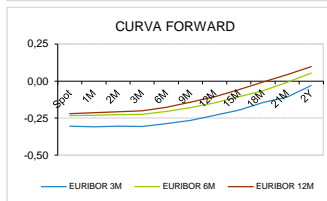
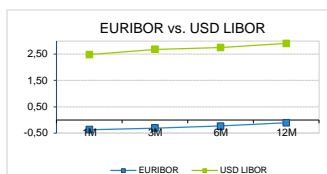
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENDA FIXA**

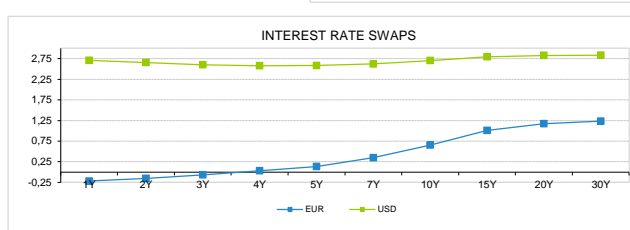
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4804	0	-3	0,7299	-0,7768
3M	-0,3080	0	0	3M	2,6829	-1	-9	0,8699	-0,7176
6M	-0,2320	0	0	6M	2,7538	1	-9	0,9881	-0,6508
12M	-0,1080	0	1	12M	2,9060	-1	-10	1,1240	-0,5098

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2192	0	0	-0,1059	0,3220	0,7950
2Y	-0,1550	0	2	-0,0045	0,4409	0,9038
3Y	-0,0680	0	1	0,1045	0,5550	1,0145
4Y	0,0300	0	-1	0,2175	0,6680	1,1180
5Y	0,1340	0	-3	0,3318	0,7800	1,2070
7Y	0,3470	0	-8	0,5546	0,9820	1,3545
10Y	0,6550	-1	-12	0,8485	1,2065	1,4945
15Y	1,0070	-1	-14	1,1498	1,3923	1,5765
20Y	1,1700	-1	-14	1,2769	1,4421	1,5595
30Y	1,2310	-1	-14	1,3058	1,4081	1,4765

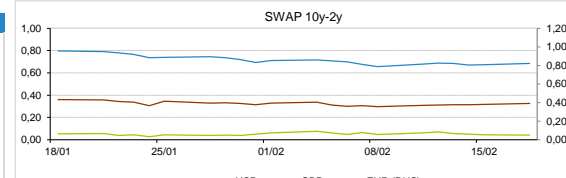
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



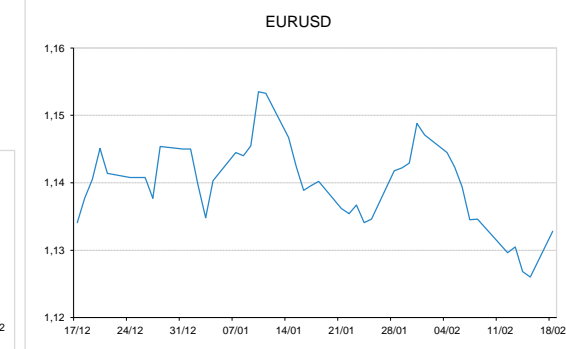
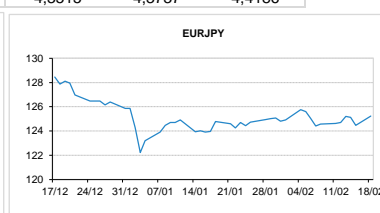
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7070	0	-5	2,6282	2,5038	2,6828
2Y	2,6530	2	-4	2,5637	2,5397	2,7246
3Y	2,6000	2	-4	2,5442	2,5878	2,7531
4Y	2,5790	2	-4	2,5528	2,6309	2,7913
5Y	2,5830	2	-3	2,5774	2,6652	2,8257
7Y	2,6210	2	-4	2,6342	2,7392	2,8811
10Y	2,7020	2	-4	2,7252	2,8163	2,9181
15Y	2,7960	1	-4	2,8075	2,8651	2,9282
20Y	2,8280	1	-4	2,8335	2,8722	2,9136
30Y	2,8310	1	-4	2,8300	2,8524	2,8768



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	66,49	0,24	3,90	OT 2Y	-0,233	0,00	-8,60
JETFUEL	651,25	3,25	34,75	OT 5Y	0,335	-0,03	-23,70
DIESEL	622,00	3,00	44,25	OT 10Y	1,511	-0,05	-24,60
COBRE	6.224,00	51,00	268,00	BUND 10Y	-0,468	0,72	-15,00
ZINCO	2.651,50	62,50	182,00	SCHATZ 2Y	0,053	-0,92	1,60
OURO	1.326,04	8,33	43,36	T-NOTE 10Y	3,391	0,82	-4,80
TRIGO	507,00	-3,50	-9,00	T-NOTE 2Y	2,883	-0,19	-1,90
LICENÇA C02	20,03	-0,39	-4,83	GILT 10Y	1,410	0,00	-14,90


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1328	0,60%	-0,65%	1,1414	1,1503	1,1686
EUR/GBP	0,8762	0,36%	0,58%	0,8789	0,8818	0,8880
EUR/JPY	125,23	-0,62%	-0,36%	125,23	125,23	125,23
EUR/CHF	1,1356	-0,04%	-0,42%	1,1346	1,1334	1,1311
EUR/BRL	4,2274	-1,08%	0,98%	4,2869	4,3540	4,4848
EUR/PLN	4,3303	0,06%	-0,96%	4,3515	4,3737	4,4186

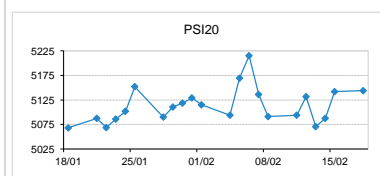

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1328	0,8762	125,23	1,1356	10,4622	7,4612	1,4963	1,58692	4,2274	9,7352
USD	0,8844	-	0,7736	110,595	1,0042	9,2577	6,5992	1,3239	1,4011	3,7393	8,6120

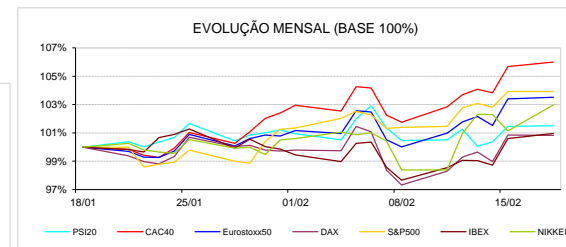
**ACCIONISTA**

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	7,280	-0,68	25,52
BCP	0,232	-1,15	1,22
CORT. AMORIM	9,770	-0,20	8,56
CTT	3,118	1,23	5,84
EDP	3,260	0,37	6,92
EDP R	8,155	0,80	4,89
GALP	14,325	-0,42	3,84
IBERSOL	8,140	0,49	3,04
J MARTINS	12,730	-0,12	23,11
MOTA ENGIL	1,934	2,55	20,12
NAVIGATOR	4,226	0,09	17,39
NOS	5,405	1,03	2,08
NOVABASE	2,520	1,61	24,75
PHAROL	0,180	-0,44	10,42
REN	2,596	-0,08	6,66
SEMAPA	15,420	0,78	17,71
SONAE CAP.	0,892	-0,34	5,06
SONAE SGPS	0,900	-0,61	11,11

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	2,55
NOVABASE	1,61
CTT	1,23
NOS	1,03
EDP R	0,80
GALP	-0,42
PHAROL	-0,44
SONAE SGPS	-0,61
ALTRI	-0,68
BCP	-1,15



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.143,68	0,03%	8,71%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.168,54	0,30%	9,26%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.244,79	0,11%	8,11%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.299,20	-0,01%	7,01%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.775,60	1,09%	10,72%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.155,50	0,35%	7,21%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.281,85	1,82%	6,33%	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.