

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

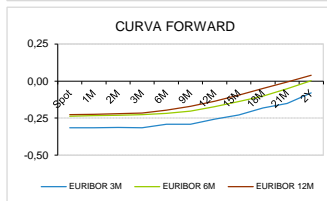
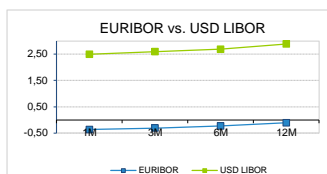
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENDA FIXA**

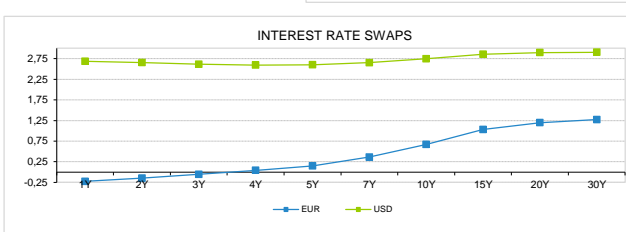
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4918	1	-2	0,7279	-0,7836
3M	-0,3080	0	0	3M	2,5945	-1	-14	0,8444	-0,7040
6M	-0,2310	0	0	6M	2,6881	0	-9	0,9835	-0,6492
12M	-0,1080	0	0	12M	2,8864	0	-8	1,1346	-0,5052

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2269	-1	-1	-0,1376	0,2400	0,6790
2Y	-0,1480	-1	0	-0,0486	0,3525	0,7945
3Y	-0,0560	-1	0	0,0480	0,4610	0,9020
4Y	0,0430	-2	0	0,1515	0,5725	1,0080
5Y	0,1480	-2	0	0,2565	0,6810	1,1040
7Y	0,3620	-2	-2	0,4715	0,8855	1,2590
10Y	0,6700	-3	-3	0,7661	1,1166	1,4095
15Y	1,0290	-3	-2	1,0748	1,3157	1,5085
20Y	1,1980	-3	-2	1,2128	1,3786	1,5025
30Y	1,2710	-3	0	1,2565	1,3587	1,4305

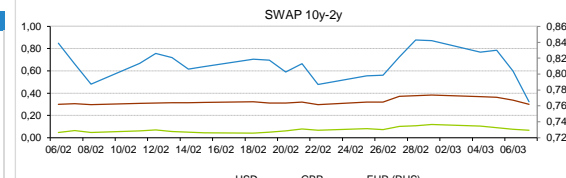
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



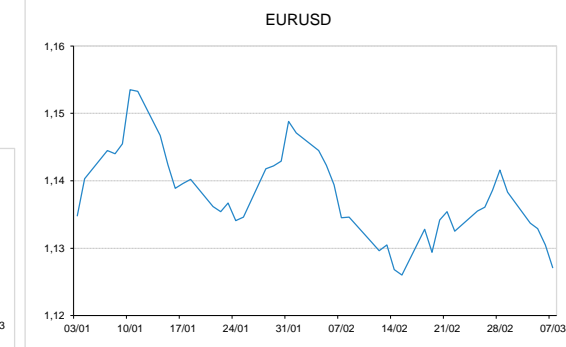
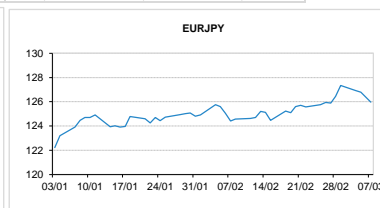
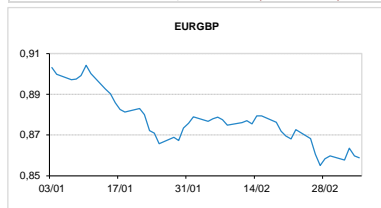
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6830	1	-4	2,5349	2,4210	2,6310
2Y	2,6550	2	-2	2,4570	2,4640	2,6860
3Y	2,6120	1	-1	2,4430	2,5205	2,7320
4Y	2,5940	1	0	2,4600	2,5750	2,7720
5Y	2,6010	1	0	2,5141	2,6210	2,8341
7Y	2,6510	1	1	2,5720	2,7030	2,8700
10Y	2,7450	0	2	2,6790	2,7960	2,9150
15Y	2,8540	0	4	2,7810	2,8530	2,9537
20Y	2,8950	0	5	2,8120	2,8882	2,9408
30Y	2,9040	0	6	2,8423	2,8733	2,8780



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	66,31	0,32	4,68	OT 2Y	-0,280	-0,03	-7,20
JETFUEL	650,35	-1,44	40,32	OT 5Y	0,215	-0,05	-25,20
DIESEL	620,60	0,43	44,32	OT 10Y	1,342	-0,08	-32,10
COBRE	6.455,00	-10,00	189,00	BUND 10Y	-0,331	-6,79	#VALUE!
ZINCO	2.806,50	2,25	87,50	SCHATZ 2Y	0,064	-3,22	-1,40
OURO	1.285,15	-1,20	-25,75	T-NOTE 10Y	3,334	-3,77	-3,90
TRIGO	443,75	-6,25	-73,25	T-NOTE 2Y	2,827	-3,70	#VALUE!
LICENÇA C02	23,09	0,96	-0,39	GILT 10Y	1,109	-5,83	-6,80


**CAMBIAL**

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1271	-0,30%	-0,65%	1,1357	1,1444	1,1622
EUR/GBP	0,8588	0,10%	2,18%	0,8615	0,8643	0,8704
EUR/JPY	125,97	0,34%	-1,24%	125,97	125,97	125,97
EUR/CHF	1,1330	0,28%	0,32%	1,1320	1,1309	1,1286
EUR/BRL	4,3589	-0,38%	-3,19%	4,4231	4,4905	4,6262
EUR/PLN	4,3119	-0,30%	-0,08%	4,3329	4,3541	4,3986

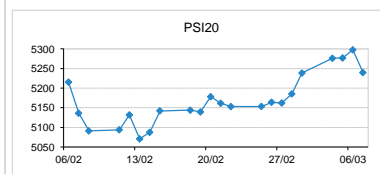

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1271	0,8588	125,97	1,1330	10,5842	7,4602	1,5050	1,5942	4,3589	9,8117
USD	0,8903	-	0,7622	111,545	1,0081	9,4156	6,6414	1,3432	1,4221	3,8698	8,7420

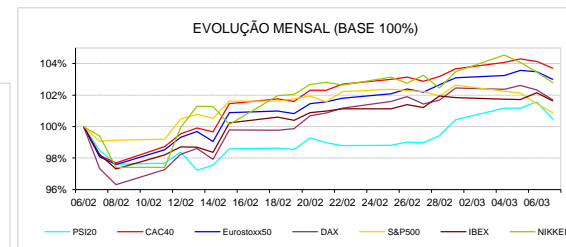
**ACCIONISTA**

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,390	-2,25	27,41
BCP	0,233	-5,12	1,66
CORT. AMORIM	10,780	-1,82	19,78
CTT	2,770	-1,98	-5,97
EDP	3,240	0,50	6,26
EDP R	8,455	0,65	8,75
GALP	14,790	-0,87	7,21
IBERSOL	8,080	0,50	2,28
J MARTINS	13,230	0,00	27,95
MOTA ENGL	2,165	-2,70	34,47
NAVIGATOR	4,374	-1,71	21,50
NOS	5,305	-0,84	0,19
NOVABASE	2,500	0,40	23,76
PHAROL	0,189	-1,04	16,05
REN	2,668	0,38	9,61
SEMAPA	15,060	-3,34	14,96
SONAE CAP.	0,893	-0,11	5,18
SONAE SGPS	0,970	-0,10	19,69

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP R	0,65
IBERSOL	0,50
EDP	0,50
NOVABASE	0,40
REN	0,38
CTT	-1,98
ALTRI	-2,25
MOTA ENGL	-2,70
SEMAPA	-3,34
BCP	-5,12



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.239,81	-1,09%	10,74%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.267,92	-0,39%	11,36%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.308,85	-0,48%	10,24%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.517,80	-0,60%	9,08%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.755,89	-0,57%	9,92%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.249,90	-0,50%	8,31%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.456,01	-0,65%	7,20%	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.