

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

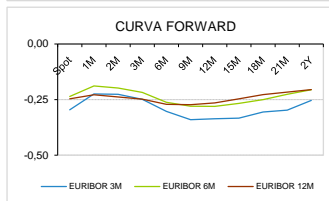
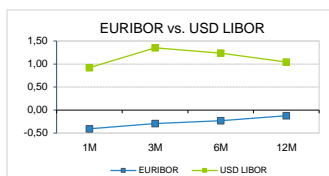
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

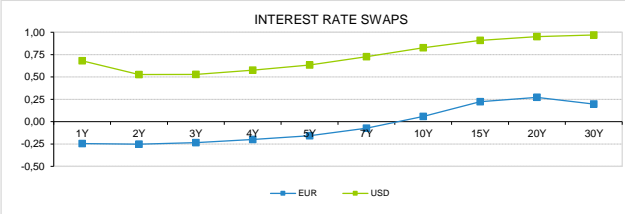
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4060	3	10	1M	0,9213	-6	6	0,2271	-0,7300
3M	-0,2930	3	18	3M	1,3524	-4	46	0,6528	-0,6040
6M	-0,2320	2	20	6M	1,2383	3	36	0,7206	-0,5294
12M	-0,1220	1	23	12M	1,0426	-1	20	0,8260	-0,4200

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2454	3	23	-0,2638	-0,0990	0,0845
2Y	-0,2520	4	24	-0,2384	-0,0430	0,1366
3Y	-0,2340	5	26	-0,1915	0,0018	0,1821
4Y	-0,2003	6	28	-0,1391	0,0485	0,2265
5Y	-0,1584	7	29	-0,0942	0,0933	0,2740
7Y	-0,0727	7	33	-0,0012	0,1816	0,3409
10Y	0,0583	8	37	0,1278	0,2875	0,4104
15Y	0,2237	8	41	0,2665	0,3561	0,4135
20Y	0,2714	8	39	0,2900	0,3301	0,3457
30Y	0,1973	7	34	0,1961	0,2053	0,2008

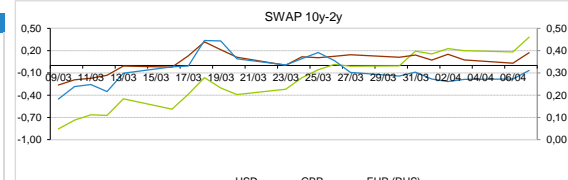
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suiza	-0,75
China	5,75
Brasil	3,75
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,6802	2	15	0,4049	0,6780	0,9396
2Y	0,5269	4	4	0,4460	0,7931	0,9605
3Y	0,5285	5	2	0,5446	0,8420	0,9878
4Y	0,5750	7	4	0,6248	0,8796	1,0088
5Y	0,6335	8	8	0,6400	0,9063	1,0296
7Y	0,7268	10	15	0,7300	0,9470	1,0120
10Y	0,8270	12	22	0,8721	0,9882	1,0474
15Y	0,9085	12	30	0,9240	1,0183	1,0582
20Y	0,9515	13	33	0,9215	1,0227	1,0491
30Y	0,9693	13	38	0,9719	1,0093	1,0161

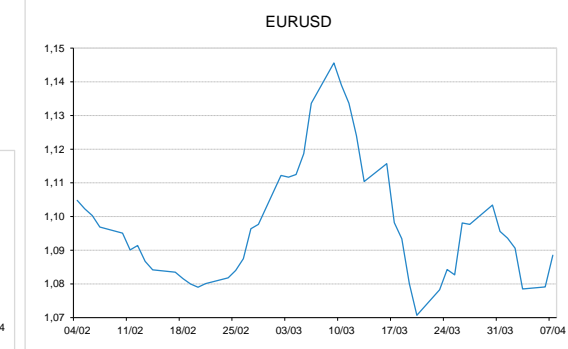
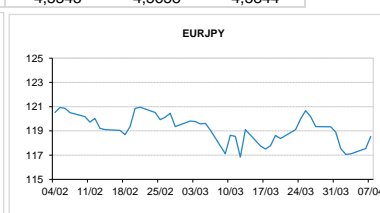


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	32,75	-0,30	-12,77	OT 2Y	0,025	0,04	41,30
JETFUEL	247,70	-4,13	-182,70	OT 5Y	0,496	0,08	55,90
DIESEL	302,67	-1,76	-118,66	OT 10Y	0,948	0,08	64,80
COBRE	4.904,50	44,50	-723,00	BUND 10Y	-0,752	9,83	41,70
ZINCO	1.895,75	21,75	-77,25	SCHATZ 2Y	-0,007	3,21	23,30
OURO	1.654,51	2,22	-19,32	T-NOTE 10Y	1,865	7,66	3,30
TRIGO	548,25	-7,50	32,50	T-NOTE 2Y	0,919	2,97	-9,80
LICENÇA C02	20,61	0,21	-2,81	GILT 10Y	0,371	8,03	21,20



### CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0885	0,87%	-4,98%	1,0916	1,0945	1,1001
EUR/GBP	0,88093	-0,33%	-0,81%	0,8826	0,8844	0,8884
EUR/JPY	118,55	-0,85%	-1,21%	118,55	118,55	118,55
EUR/CHF	1,0567	-0,11%	0,35%	1,0560	1,0553	1,0538
EUR/BRL	5,7006	0,01%	-5,19%	5,7410	5,7748	5,8310
EUR/PLN	4,5373	0,50%	-4,62%	4,5545	4,5658	4,5844



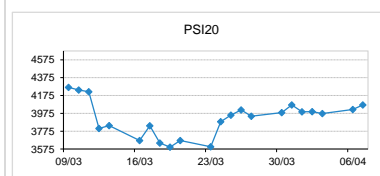
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0885	0,8809	118,55	1,0567	10,9234	7,4661	1,5209	1,76028	5,7006	11,1565
USD	0,9187	-	0,8127	108,955	0,9712	10,0134	6,8588	1,4011	1,6189	5,2419	10,2328

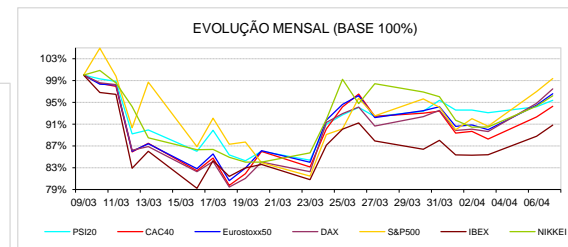
### ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	4,108	3,48	-27,68
BCP	0,097	5,80	-52,32
CORT. AMORIM	8,330	1,71	-26,28
CTT	2,240	0,67	-29,78
EDP	3,606	1,66	-6,68
EDP R	10,380	-0,76	-1,14
GALP	10,025	1,06	-32,72
IBERSOL	4,650	-1,90	-41,88
J MARTINS	15,500	-3,13	5,69
MOTA ENGIL	1,244	2,64	-33,48
NAVIGATOR	2,316	5,08	-32,84
NOS	3,126	-0,38	-34,88
PHAROL	0,067	2,78	-33,23
RAMADA	2,930	5,40	-49,83
REN	2,400	0,42	-11,76
SEMAPA	8,740	5,94	-36,30
SONAE CAP.	0,467	2,64	-37,98
SONAE SGPS	0,667	3,89	-26,70

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
SEMAPA	5,94
BCP	5,80
RAMADA	5,40
NAVIGATOR	5,08
SONAE SGPS	3,89
NOS	-0,38
EDP R	-0,76
IBERSOL	-1,90
J MARTINS	-3,13



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.069,46	1,27%	-21,95%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.438,27	2,12%	-25,76%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.857,67	2,21%	-23,70%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	10.356,70	2,79%	-21,83%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.730,12	2,52%	-15,48%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.002,00	2,30%	-26,67%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	18.950,18	2,01%	-19,89%	24.115,95	16.358,19



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.