

# AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

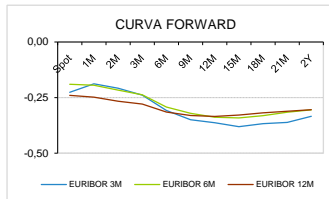
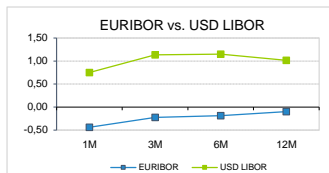
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

## RENTA FIXA

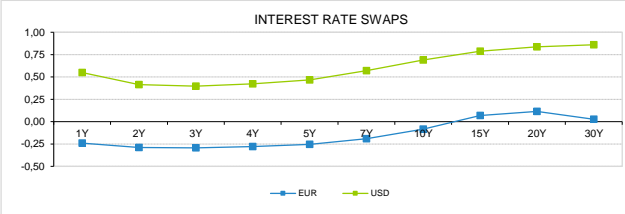
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,4380	-2	5	1M	0,7508	-4	-5	0,2563
3M	-0,2240	3	19	3M	1,1349	-4	29	0,6678
6M	-0,1870	1	19	6M	1,1501	-1	33	0,7454
12M	-0,0980	1	17	12M	1,0141	-1	19	0,8544

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2400	1	15	-0,3409	-0,2313	-0,0763
2Y	-0,2885	1	10	-0,3258	-0,1940	-0,0380
3Y	-0,2932	0	7	-0,2945	-0,1551	0,0059
4Y	-0,2793	-1	3	-0,2588	-0,1163	0,0455
5Y	-0,2540	-1	0	-0,2226	-0,0745	0,0885
7Y	-0,1910	-1	-2	-0,1453	0,0042	0,1527
10Y	-0,0836	-2	-2	-0,0304	0,1081	0,2272
15Y	0,0694	-2	3	0,1028	0,1810	0,2354
20Y	0,1146	-2	7	0,1240	0,1526	0,1626
30Y	0,0270	-3	13	0,0184	0,0192	0,0116

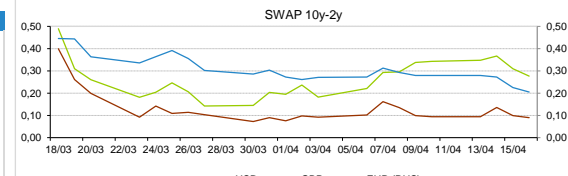
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,75
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,5500	0	5	0,3238	0,4855	0,7670
2Y	0,4143	0	-4	0,2990	0,5630	0,8319
3Y	0,3969	-1	-11	0,3475	0,6235	0,8645
4Y	0,4227	-1	-15	0,4537	0,6545	0,8941
5Y	0,4662	-2	-16	0,5030	0,7245	0,9228
7Y	0,5700	-3	-14	0,5875	0,7695	0,9404
10Y	0,6903	-4	-9	0,7382	0,8515	0,9115
15Y	0,7870	-6	-1	0,7775	0,9030	0,9644
20Y	0,8368	-6	3	0,8529	0,9145	0,9513
30Y	0,8600	-8	7	0,8604	0,8872	0,8975

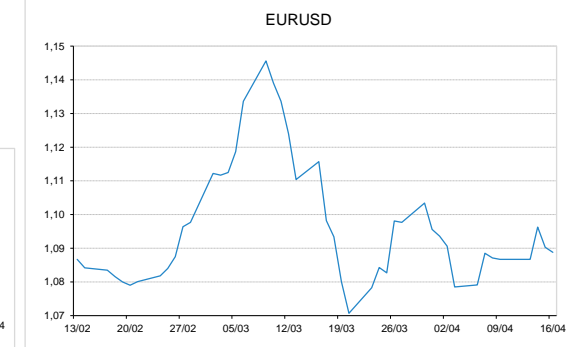
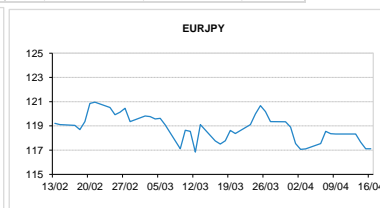
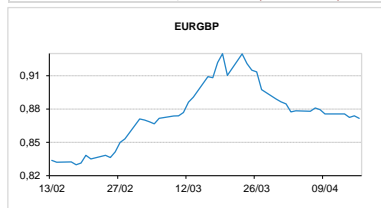


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	27,38	-0,31	-4,31	OT 2Y	0,146	0,01	0,60
JETFUEL	203,04	3,29	-92,23	OT 5Y	0,535	-0,02	-23,50
DIESEL	257,03	3,18	-56,20	OT 10Y	0,963	-0,02	-30,70
COBRE	5.111,50	-51,50	-348,50	BUND 10Y	-0,913	-0,34	-5,50
ZINCO	1.926,00	11,00	-56,50	SCHATZ 2Y	-0,076	1,14	14,60
OURO	1.723,87	9,43	231,53	T-NOTE 10Y	1,714	-0,70	-30,50
TRIGO	535,25	-5,25	35,75	T-NOTE 2Y	0,830	-0,37	-18,50
LICENÇA C02	20,98	1,73	1,51	GILT 10Y	0,259	0,68	-23,40



## CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0888	-0,14%	-2,41%	1,0914	1,0939	1,0994
EUR/GBP	0,87163	0,25%	4,31%	0,8731	0,8749	0,8788
EUR/JPY	117,12	0,00%	0,55%	117,12	117,12	117,12
EUR/CHF	1,0511	0,15%	0,55%	1,0503	1,0495	1,0478
EUR/BRL	5,6705	0,77%	-1,41%	5,7076	5,7384	5,8020
EUR/PLN	4,5470	-0,43%	-2,31%	4,5599	4,5703	4,5893



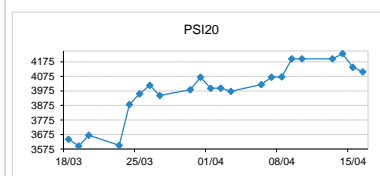
## FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0888	0,8716	117,12	1,0511	10,8824	7,4610	1,5331	1,72	5,6705	11,3514
USD	0,9216	-	0,8032	107,535	0,9688	10,0375	6,8761	1,4124	1,5847	5,2429	10,4847

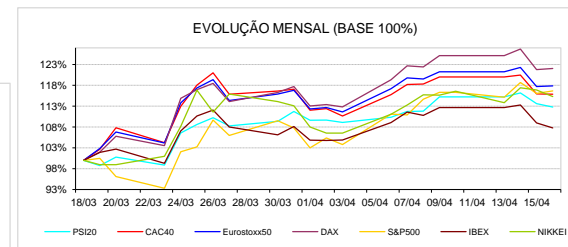
## ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	4,416	0,45	-22,25
BCP	0,096	-2,94	-52,71
CORT. AMORIM	8,400	0,12	-25,66
CTT	2,335	2,19	-26,80
EDP	3,769	2,14	-2,46
EDP R	10,740	2,29	2,29
GALP	9,262	-3,98	-37,84
IBERSOL	4,400	-1,12	-45,00
J MARTINS	15,625	-1,01	6,55
MOTA ENGIL	1,200	-1,15	-35,83
NAVIGATOR	2,324	-1,69	-32,61
NOS	3,334	-3,42	-30,54
PHAROL	0,069	0,00	-31,02
RAMADA	2,850	-2,06	-51,20
REN	2,440	0,00	-10,29
SEMAPA	8,870	0,34	-35,35
SONAE CAP.	0,480	-3,03	-36,25
SONAE SGPS	0,651	0,00	-28,46

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP R	2,29
CTT	2,19
EDP	2,14
ALTRI	0,45
SEMAPA	0,34
RAMADA	-2,06
BCP	-2,94
SONAE CAP.	-3,03
NOS	-3,42
GALP	-3,98



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.106,81	-0,75%	-21,24%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.350,16	-0,08%	-27,23%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.812,35	0,15%	-24,91%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	10.301,54	0,21%	-22,25%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.798,26	0,54%	-13,39%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.763,40	-1,11%	-29,17%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	19.290,20	-1,33%	-18,46%	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.