

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

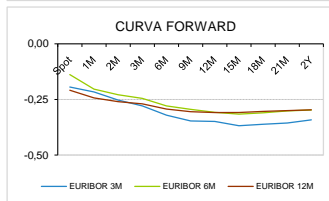
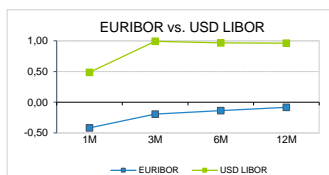
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

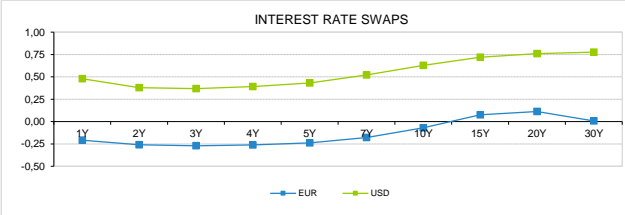
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4180	-2	4	1M	0,4873	-8	-46	0,2243	-0,7196
3M	-0,1920	-3	18	3M	0,9914	-3	-22	0,6218	-0,5766
6M	-0,1360	-2	17	6M	0,9653	-3	-1	0,7198	-0,5296
12M	-0,0830	-2	11	12M	0,9603	-1	2	0,8838	-0,4338

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2085	-4	10	-0,3137	-0,2320	-0,0799
2Y	-0,2600	-5	2	-0,3070	-0,1930	-0,0333
3Y	-0,2708	-5	-3	-0,2816	-0,1553	0,0095
4Y	-0,2613	-5	-6	-0,2500	-0,1129	0,0511
5Y	-0,2387	-5	-9	-0,2158	-0,0711	0,0950
7Y	-0,1789	-5	-14	-0,1382	0,0120	0,1614
10Y	-0,0700	-5	-15	-0,0210	0,1134	0,2279
15Y	0,0758	-5	-14	0,1035	0,1756	0,2244
20Y	0,1125	-5	-15	0,1158	0,1370	0,1415
30Y	0,0070	-5	-16	-0,0064	-0,0105	-0,0226

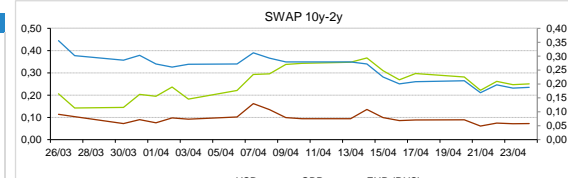
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,75
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,4798	-4	-17	0,3305	0,4892	0,6690
2Y	0,3790	-2	-14	0,3365	0,5170	0,7410
3Y	0,3684	-1	-15	0,3797	0,5710	0,7816
4Y	0,3916	-2	-15	0,4130	0,6300	0,8030
5Y	0,4315	-2	-15	0,4645	0,6760	0,8327
7Y	0,5219	-2	-13	0,5824	0,7335	0,8485
10Y	0,6290	-2	-9	0,6645	0,7908	0,8575
15Y	0,7197	-1	-5	0,7370	0,8150	0,8640
20Y	0,7596	-1	-2	0,7753	0,8200	0,8601
30Y	0,7761	-1	-1	0,7770	0,8075	0,8127

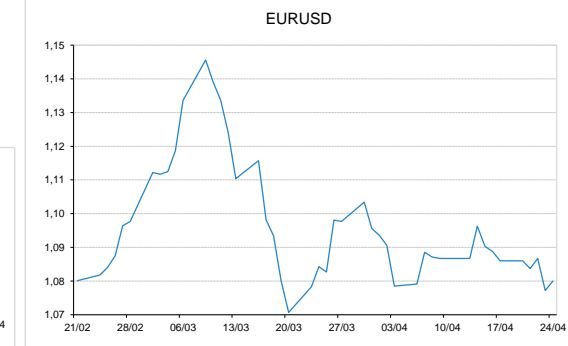
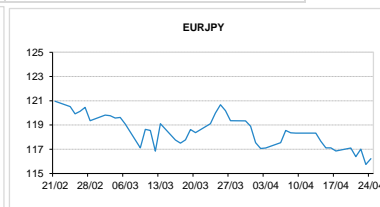
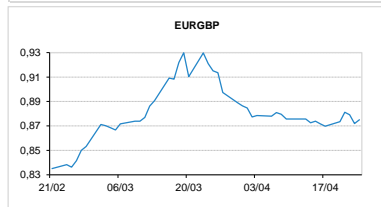


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	21,56	0,23	-8,18	OT 2Y	0,090	-0,11	7,00
JETFUEL	151,00	2,01	-96,31	OT 5Y	0,651	-0,10	10,90
DIESEL	210,50	3,01	-86,20	OT 10Y	1,085	-0,11	3,10
COBRE	5.139,00	29,00	530,50	BUND 10Y	-0,916	-4,59	-21,80
ZINCO	1.863,50	-22,50	45,75	SCHATZ 2Y	-0,089	-2,29	-11,70
OURO	1.713,17	-12,99	85,31	T-NOTE 10Y	1,728	-0,56	-15,70
TRIGO	540,00	-4,75	-15,25	T-NOTE 2Y	0,854	-0,37	-1,30
LICENÇA C02	20,71	-0,32	3,93	GILT 10Y	0,252	0,34	-15,40



### CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,08	0,26%	-0,40%	1,0824	1,0848	1,0901
EUR/GBP	0,87498	-0,34%	5,26%	0,8764	0,8781	0,8819
EUR/JPY	116,22	-0,40%	3,24%	116,22	116,22	116,22
EUR/CHF	1,0529	-0,07%	0,46%	1,0522	1,0514	1,0495
EUR/BRL	6,1419	-2,88%	-10,47%	6,1676	6,1752	6,2122
EUR/PLN	4,5397	0,09%	1,43%	4,5508	4,5586	4,5754



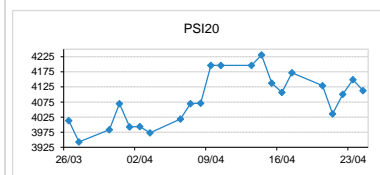
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0800	0,8750	116,22	1,0529	10,8780	7,4594	1,5225	1,69366	6,1419	11,5313
USD	0,9249	-	0,8106	107,435	0,9738	10,0603	6,8988	1,4086	1,5683	5,6968	10,6606

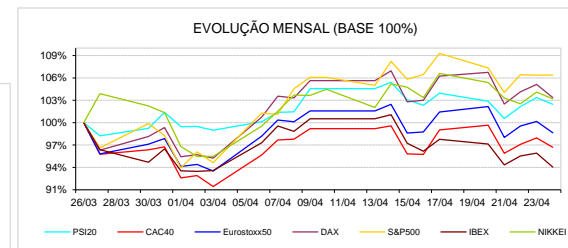
### ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,606	-2,42	-18,91
BGP	0,095	-1,97	-53,40
CORT. AMORIM	8,800	-0,34	-22,12
CTT	2,125	-1,85	-33,39
EDP	3,769	-0,53	-2,46
EDP R	10,600	0,19	0,95
GALP	9,414	-0,13	-36,82
IBERSOL	4,000	-0,50	-50,00
J MARTINS	15,745	-0,97	7,36
MOTA ENGIL	1,070	-1,29	-42,78
NAVIGATOR	2,248	-4,18	-34,81
NOS	3,396	-0,70	-29,25
PHAROL	0,068	-1,88	-31,73
RAMADA	2,890	-2,03	-50,51
REN	2,450	0,41	-9,93
SEMAPA	8,630	-3,79	-37,10
SONAE CAP.	0,481	0,42	-36,12
SONAE SGPS	0,682	-0,29	-25,11
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE CAP.	0,42
REN	0,41
EDP R	0,19
BGP	-1,97
RAMADA	-2,03
ALTRI	-2,42
SEMAPA	-3,79
NAVIGATOR	-4,18



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.112,48	-0,88%	-21,13%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.393,32	-1,30%	-26,51%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.809,07	-1,52%	-24,99%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	10.336,09	-1,69%	-21,99%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.797,62	0,01%	-13,40%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.613,90	-1,97%	-30,74%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	19.262,00	-0,86%	-18,58%	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.