

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

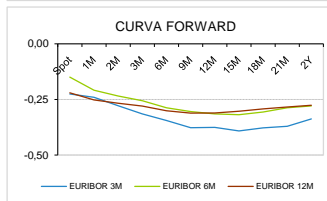
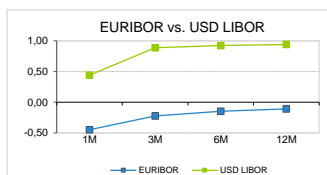
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

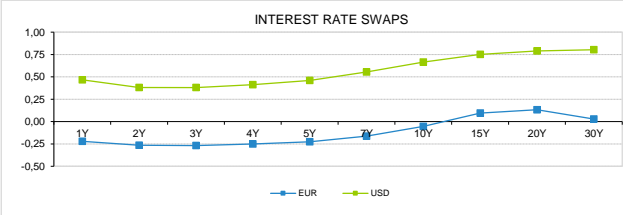
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4480	-3	-1	1M	0,4409	-5	-48	0,2269	-0,7144
3M	-0,2230	-3	13	3M	0,8871	-10	-35	0,6373	-0,5734
6M	-0,1470	-1	13	6M	0,9223	-4	-6	0,7155	-0,5364
12M	-0,1090	-3	4	12M	0,9395	-2	-2	0,8810	-0,4306

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2205	-1	9	-0,3107	-0,2062	-0,0554
2Y	-0,2650	-1	6	-0,2936	-0,1632	-0,0149
3Y	-0,2685	0	4	-0,2662	-0,1270	0,0277
4Y	-0,2515	1	2	-0,2298	-0,0890	0,0698
5Y	-0,2255	1	1	-0,1947	-0,0480	0,1140
7Y	-0,1632	1	-2	-0,1186	0,0348	0,1840
10Y	-0,0538	1	-3	-0,0004	0,1377	0,2513
15Y	0,0949	2	-6	0,1264	0,1994	0,2491
20Y	0,1325	2	-8	0,1397	0,1634	0,1676
30Y	0,0280	1	-13	0,0175	0,0132	-0,0003

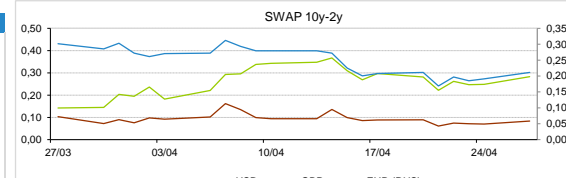
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,75
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,4670	-1	-23	0,3448	0,5659	0,7490
2Y	0,3804	0	-12	0,3537	0,5705	0,7955
3Y	0,3801	0	-8	0,3840	0,6300	0,8270
4Y	0,4119	0	-7	0,4727	0,6470	0,8519
5Y	0,4595	1	-5	0,5295	0,7170	0,8755
7Y	0,5548	2	-1	0,6220	0,7790	0,8926
10Y	0,6645	3	2	0,7178	0,8321	0,8492
15Y	0,7515	4	4	0,7812	0,8585	0,9040
20Y	0,7899	5	5	0,8084	0,8540	0,8909
30Y	0,8034	5	5	0,7622	0,8385	0,8493

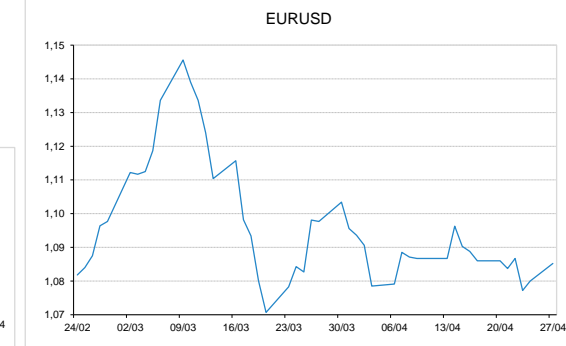
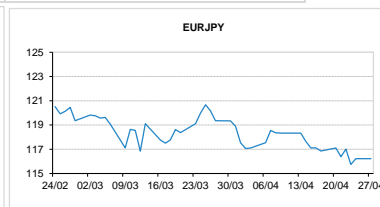
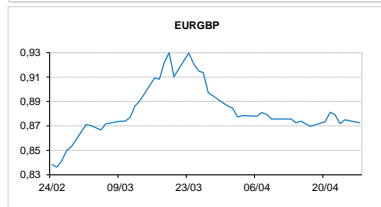


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	19,30	-2,14	-8,65	OT 2Y	0,045	-0,05	16,60
JETFUEL	125,25	-13,75	-129,00	OT 5Y	0,576	-0,08	31,50
DIESEL	185,70	-12,30	-120,77	OT 10Y	1,019	-0,07	30,20
COBRE	5.188,00	-21,00	325,50	BUND 10Y	-0,896	1,92	-9,70
ZINCO	1.874,75	11,25	61,25	SCHATZ 2Y	-0,053	3,66	-3,70
OURO	1.710,44	-19,17	82,28	T-NOTE 10Y	1,763	3,80	-8,60
TRIGO	524,75	-5,75	-32,50	T-NOTE 2Y	0,865	1,11	1,70
LICENÇA C02	20,32	-0,42	3,93	GILT 10Y	0,262	1,61	-8,00



### CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0852	0,48%	-1,14%	1,0875	1,0899	1,0952
EUR/GBP	0,87263	0,27%	2,84%	0,8740	0,8756	0,8794
EUR/JPY	116,22	0,00%	2,70%	116,22	116,22	116,22
EUR/CHF	1,0566	-0,34%	0,32%	1,0559	1,0550	1,0530
EUR/BRL	6,1437	-1,50%	-7,54%	6,1703	6,1687	6,2023
EUR/PLN	4,5335	0,00%	0,03%	4,5446	4,5519	4,5690



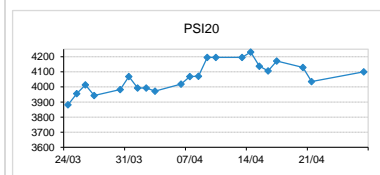
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0852	0,8726	116,22	1,0566	10,8800	7,4569	1,5206	1,67635	6,1437	11,4547
USD	0,9225	-	0,8059	107,195	0,9756	10,0402	6,8788	1,4048	1,5473	5,6421	10,5681

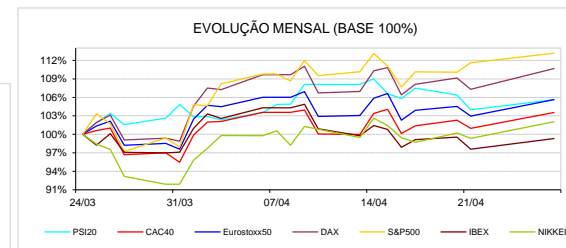
### ACCIONISTA

TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,626	0,43	-18,56
BCP	0,094	-0,74	-53,75
CORT. AMORIM	9,050	2,84	-19,91
CTT	2,130	0,24	-33,23
EDP	3,800	0,82	-1,66
EDP R	10,820	2,08	3,05
GALP	9,462	0,51	-36,50
IBERSOL	3,970	-0,75	-50,38
J MARTINS	15,705	-0,25	7,09
MOTA ENGIL	1,062	-0,75	-43,21
NAVIGATOR	2,244	-0,18	-34,93
NOS	3,390	-0,18	-29,38
PHAROL	0,068	0,00	-31,73
RAMADA	2,960	2,42	-49,32
REN	2,470	0,82	-9,19
SEMAPA	8,770	1,62	-36,08
SONAE CAP.	0,474	-1,46	-37,05
SONAE SGPS	0,693	1,61	-23,90

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	2,84
RAMADA	2,42
EDP R	2,08
SEMAPA	1,62
SONAE SGPS	1,61
J MARTINS	-0,25
BCP	-0,74
MOTA ENGIL	-0,75
IBERSOL	-0,75
SONAE CAP.	-1,46



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.136,58	0,59%	-20,67%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.505,26	2,55%	-24,64%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.882,11	2,60%	-23,04%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	10.659,99	3,13%	-19,54%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.876,23	1,39%	-10,97%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.731,80	1,78%	-29,50%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	19.783,22	2,71%	-16,37%	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.