

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

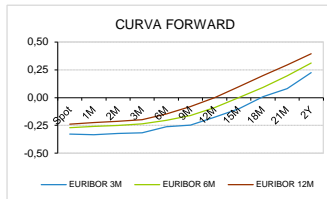
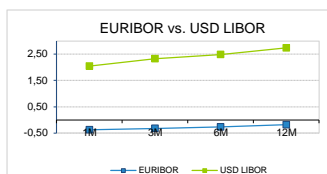
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

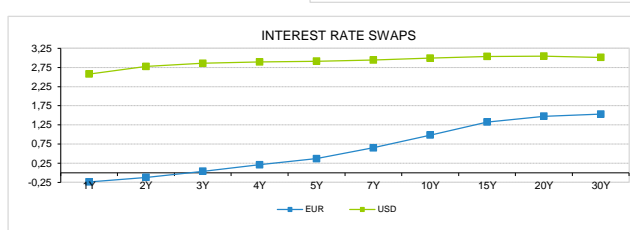
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,0462	0	12	0,4977	-0,7936
3M	-0,3210	0	1	3M	2,3263	0	-3	0,6272	-0,7338
6M	-0,2670	0	0	6M	2,4888	0	-4	0,7586	-0,6454
12M	-0,1810	0	1	12M	2,7403	-1	-3	0,9355	-0,5242

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2377	0	2	-0,0061	0,7623	1,3116
2Y	-0,1210	-1	3	0,1943	0,9127	1,4199
3Y	0,0410	-2	2	0,3821	1,0446	1,5140
4Y	0,2100	-3	1	0,5518	1,1638	1,5993
5Y	0,3690	-4	0	0,7011	1,2693	1,6740
7Y	0,6520	-5	0	0,9558	1,4472	1,7850
10Y	0,9840	-5	2	1,2424	1,6297	1,8860
15Y	1,3240	-5	2	1,5107	1,7718	1,9330
20Y	1,4770	-5	2	1,6171	1,7983	1,8980
30Y	1,5320	-5	3	1,6299	1,7470	1,8070

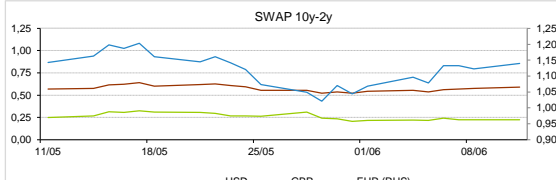
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5790	-1	1	3,0022	3,0478	2,9751
2Y	2,7740	-2	0	3,0318	3,0230	3,0280
3Y	2,8570	-3	-1	3,0175	3,0463	3,0813
4Y	2,8940	-3	-2	3,0146	3,0180	3,0625
5Y	2,9120	-3	-3	3,0099	3,0305	3,1162
7Y	2,9440	-3	-3	3,0225	3,0920	3,1045
10Y	2,9910	-3	-2	3,0670	3,1176	3,1100
15Y	3,0370	-3	-2	3,0795	3,1208	3,0960
20Y	3,0450	-3	-3	3,1029	3,1024	3,0740
30Y	3,0100	-2	-3	3,0533	3,0230	3,0070

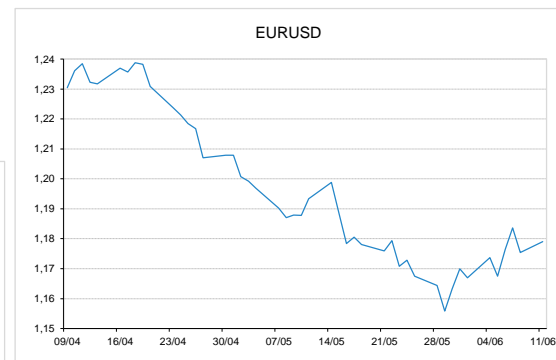
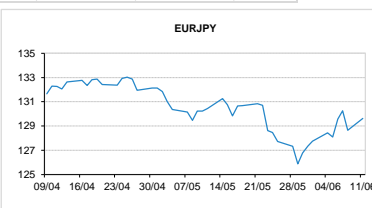
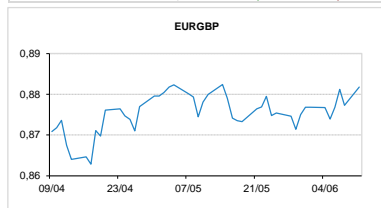


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	76,55	0,09	-0,39	OT 2Y	-0,038	-0,06	12,60
JETFUEL	712,67	-1,80	-15,33	OT 5Y	0,823	-0,09	24,40
DIESEL	669,67	-1,55	-12,08	OT 10Y	1,999	-0,06	27,40
COBRE	7.305,50	-20,00	567,00	BUND 10Y	0,018	4,81	-6,70
ZINCO	3.223,50	19,50	165,00	SCHATZ 2Y	0,023	3,90	-6,90
OURO	1.300,77	2,61	-21,30	T-NOTE 10Y	3,658	1,35	-4,60
TRIGO	514,25	-5,75	15,50	T-NOTE 2Y	2,953	2,34	-8,20
LICENÇA C02	15,47	-0,35	0,84	GILT 10Y	1,638	1,17	-3,00



### CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,179	0,31%	-1,21%	1,1874	1,1962	1,2161
EUR/GBP	0,8818	-0,51%	-0,20%	0,8842	0,8869	0,8931
EUR/JPY	129,62	-0,76%	0,63%	129,62	129,62	129,62
EUR/CHF	1,1617	-0,23%	2,85%	1,1606	1,1595	1,1571
EUR/BRL	4,35	0,36%	-1,14%	4,4205	4,4905	4,6519
EUR/PLN	4,2684	0,22%	-0,05%	4,2908	4,3132	4,3601



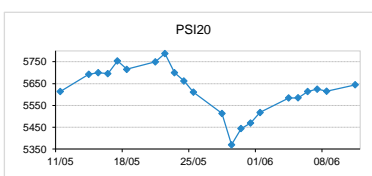
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1790	0,8818	129,62	1,1617	10,2134	7,4496	1,5317	1,54902	4,3500	9,4764
USD	0,8471	-	0,7467	109,895	0,9844	8,6595	6,3106	1,3003	1,3141	3,6811	8,0347

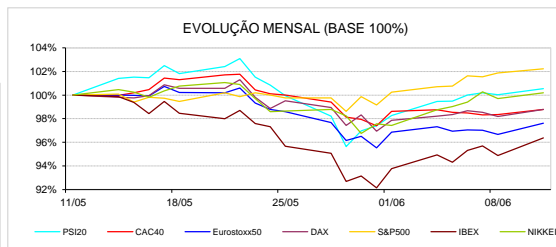
### ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,690	-1,70	68,05
BCP	0,274	3,13	0,62
CORT. AMORIM	11,3800	-0,52	10,49
CTT	2,7960	-0,50	-20,27
EDP	3,372	-0,12	16,88
EDP R	8,245	1,17	18,34
GALP	16,250	1,03	6,04
IBERSOL	10,950	-0,45	-9,88
J MARTINS	13,290	-0,34	-17,94
MOTA ENGIL	3,200	-0,62	-12,64
NAVIGATOR	5,940	0,68	39,70
NOS	4,660	0,30	-14,98
NOVABASE	2,760	-0,72	-9,48
PHAROL	0,260	0,39	4,00
REN	2,336	0,09	-5,77
SEMAPA	23,500	-0,42	32,06
SONAE CAP.	0,935	-0,53	5,41
SONAE SGPS	1,103	0,73	-2,04

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	3,13
EDP R	1,17
GALP	1,03
SONAE SGPS	0,73
NAVIGATOR	0,68
CORT. AMORIM	-0,52
SONAE CAP.	-0,53
MOTA ENGIL	-0,62
NOVABASE	-0,72
ALTRI	-1,70



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.644,59	0,52%	4,76%	5.801,45	5.014,62
CAC40	5.473,91	0,43%	3,04%	5.657,44	4.995,07
ESTX 50 PR	3.480,22	0,95%	-0,68%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.842,91	0,60%	-0,58%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.788,79	0,35%	4,31%	2.872,87	2.405,70
IBEX 35	9.898,30	1,56%	-1,45%	11.048,00	9.327,60
NIKKEI 225	22.804,04	0,48%	0,17%	24.129,34	19.239,52



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.