

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

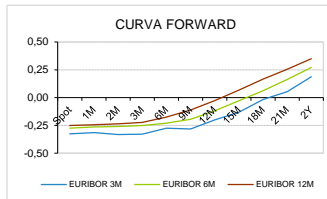
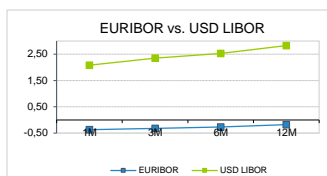
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

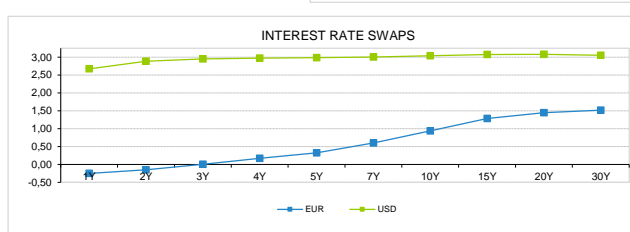
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3690	0	0	1M	2,0814	0	-1	0,6803	-0,7766
3M	-0,3190	0	0	3M	2,3486	1	1	0,7983	-0,7278
6M	-0,2690	0	0	6M	2,5305	0	3	0,9000	-0,6484
12M	-0,1770	0	0	12M	2,8278	1	6	1,0504	-0,5148

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2509	0	0	-0,0289	0,7031	1,2440
2Y	-0,1490	0	2	0,1616	0,8495	1,3530
3Y	0,0060	0	3	0,3408	0,9808	1,4510
4Y	0,1700	0	4	0,5036	1,0986	1,5410
5Y	0,3260	0	4	0,6499	1,2076	1,6190
7Y	0,6010	0	5	0,9026	1,3920	1,7422
10Y	0,9370	0	4	1,1940	1,5800	1,8450
15Y	1,2870	0	4	1,4725	1,7369	1,9090
20Y	1,4480	0	5	1,5901	1,7752	1,8845
30Y	1,5190	0	5	1,6195	1,7407	1,8093

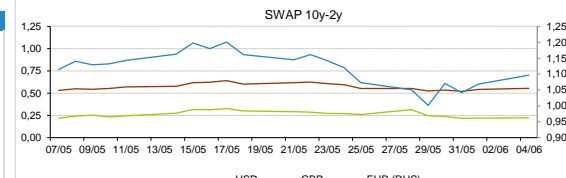
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,50
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6740	0	7	3,1023	3,0485	3,0560
2Y	2,8850	1	9	3,0850	3,0450	3,0595
3Y	2,9510	1	9	3,0625	3,0135	3,0490
4Y	2,9740	1	9	3,0450	3,0395	3,0940
5Y	2,9850	2	10	3,0320	3,0460	3,1343
7Y	3,0050	2	11	3,0300	3,1125	3,1180
10Y	3,0400	2	12	3,1209	3,1341	3,1300
15Y	3,0760	2	12	3,1345	3,1374	3,1210
20Y	3,0800	2	13	3,1265	3,1215	3,1182
30Y	3,0530	2	14	3,0893	3,0755	3,0420

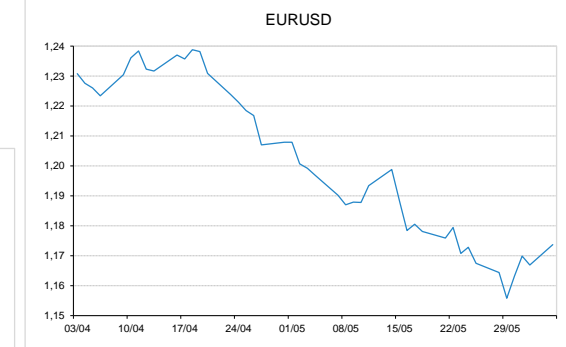
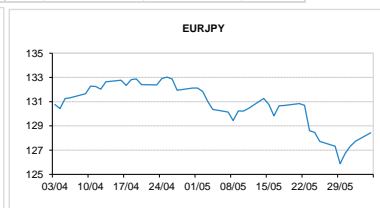
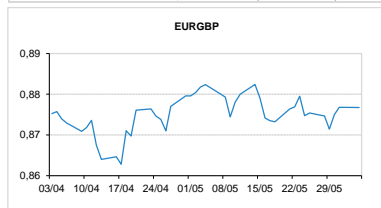


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	72,57	-1,64	-6,29	OT 2Y	-0,153	0,03	17,90
JETFUEL	685,24	-15,26	-37,76	OT 5Y	0,568	0,04	8,70
DIESEL	643,99	-14,51	-36,17	OT 10Y	1,788	0,05	14,70
COBRE	6 322,00	50,00	-326,00	BUND 10Y	-0,076	4,17	-17,20
ZINCO	2 636,00	68,75	-226,50	SCHATZ 2Y	0,060	1,61	-9,80
OURO	1 218,77	-5,47	-34,40	T-NOTE 10Y	3,688	2,54	-5,10
TRIGO	562,00	8,25	60,75	T-NOTE 2Y	3,059	1,17	-7,50
LICENÇA C02	17,77	0,37	2,78	GILT 10Y	1,587	4,34	-11,20



### CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1696	-0,34%	0,49%	1,1779	1,1871	1,2064
EUR/GBP	0,8904	0,20%	-0,44%	0,8931	0,8961	0,9025
EUR/JPY	130,81	0,02%	-1,49%	130,81	130,81	130,81
EUR/CHF	1,1573	0,06%	-0,07%	1,1562	1,1550	1,1528
EUR/BRL	4,3779	0,34%	3,99%	4,4496	4,5189	4,6836
EUR/PLN	4,2612	0,35%	3,25%	4,2850	4,3088	4,3565



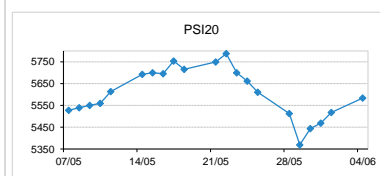
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1696	0,8904	130,81	1,1573	10,2708	7,4511	1,5177	1,57722	4,3779	9,5365
USD	0,8567	-	0,7621	111,975	0,9930	8,8028	6,3830	1,2980	1,3500	3,7427	8,1653

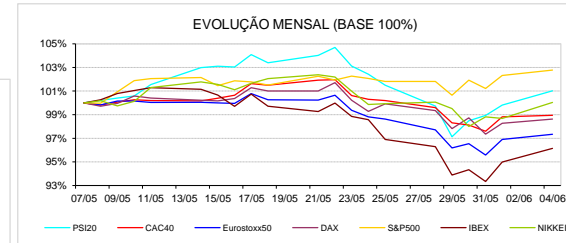
### ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,800	0,57	70,18
BCP	0,270	0,41	-0,92
CORT. AMORIM	11,3200	0,18	9,90
CTT	2,9800	-0,86	-15,03
EDP	3,533	1,26	22,46
EDP R	8,780	-0,57	26,02
GALP	17,735	0,82	15,73
IBERSOL	9,840	-1,60	-2,81
J MARTINS	12,645	-0,67	-21,92
MOTA ENGIL	2,875	0,35	-21,51
NAVIGATOR	4,914	0,61	16,44
NOS	4,960	-0,44	-9,51
NOVABASE	2,690	-0,74	-11,77
PHAROL	0,229	-0,87	-8,60
REN	2,500	-0,24	0,85
SEMAPA	20,350	1,24	14,36
SONAE CAP.	0,895	-0,22	0,90
SONAE SGPS	0,989	1,70	-12,17

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
SONAE SGPS	1,70
EDP	1,26
SEMAPA	1,24
GALP	0,82
NAVIGATOR	0,61
J MARTINS	-0,67
NOVABASE	-0,74
CTT	-0,86
PHAROL	-0,87
IBERSOL	-1,60



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5 637,27	0,31%	4,62%	5 801,45	5 014,62
CAC40	5 498,37	-0,23%	3,50%	5 657,44	4 995,07
ESTX 50 PR	3 509,23	-0,46%	0,15%	3 708,82	3 261,86
XTRA DAX	12 737,05	-0,53%	-1,40%	13 596,89	11 726,62
S&P 500	2 813,29	-0,09%	5,24%	2 872,87	2 417,35
IBEX 35	9 799,30	-0,72%	-2,44%	10 758,20	9 327,60
NIKKEI 225	22 746,70	0,86%	-0,08%	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.