

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

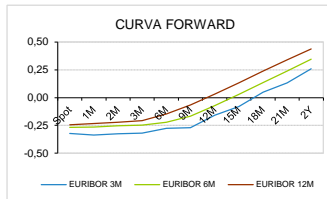
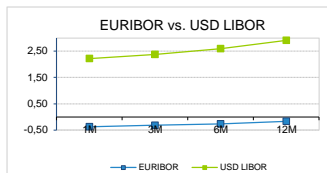
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

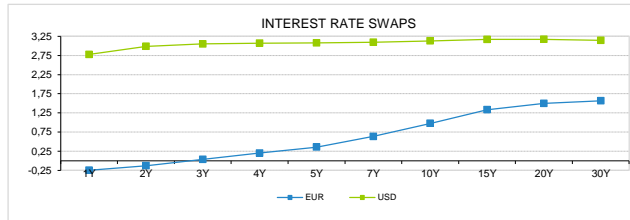
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3700	0	0	1M	2,2182	0	15	0,7244	-0,7788
3M	-0,3190	0	0	3M	2,3736	0	6	0,8015	-0,7330
6M	-0,2670	0	0	6M	2,5936	0	7	0,8986	-0,6536
12M	-0,1650	0	0	12M	2,9089	0	9	1,0566	-0,5206

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2456	0	0	0,0312	0,7920	1,3168
2Y	-0,1260	0	3	0,2310	0,9380	1,4213
3Y	0,0360	0	5	0,4170	1,0610	1,5085
4Y	0,2020	0	7	0,5846	1,1783	1,5960
5Y	0,3580	0	8	0,7280	1,2765	1,6730
7Y	0,6360	0	10	0,9715	1,4555	1,7968
10Y	0,9760	0	10	1,2575	1,6412	1,8970
15Y	1,3320	0	10	1,5280	1,7887	1,9555
20Y	1,4970	0	10	1,6430	1,8249	1,9270
30Y	1,5660	1	10	1,6622	1,7805	1,8425

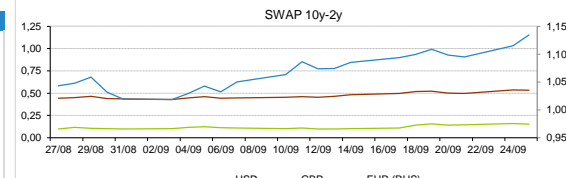
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,00
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,50
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,7740	0	15	3,2257	3,1560	3,1533
2Y	2,9860	0	19	3,2257	3,1390	3,1480
3Y	3,0500	0	20	3,1850	3,1285	3,1824
4Y	3,0690	0	21	3,1730	3,1440	3,1700
5Y	3,0770	0	21	3,1670	3,1510	3,2128
7Y	3,0940	0	22	3,1872	3,1979	3,2070
10Y	3,1290	-1	21	3,1895	3,2211	3,2428
15Y	3,1660	-1	21	3,2284	3,2268	3,2100
20Y	3,1720	-1	21	3,2217	3,2132	3,1840
30Y	3,1430	-1	20	3,1808	3,1420	3,1320

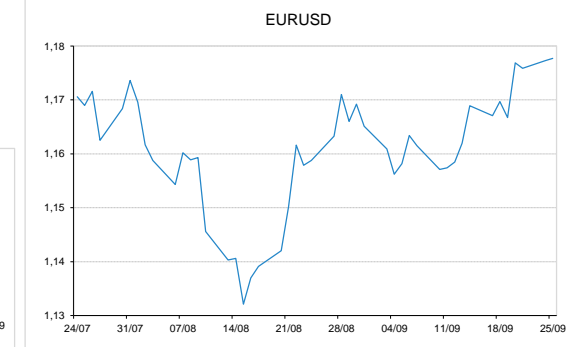
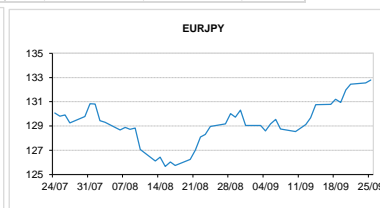
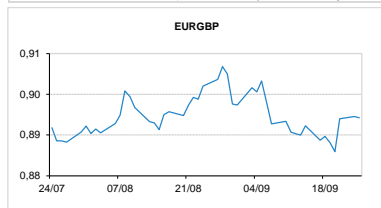


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	81,93	0,73	5,80	OT 2Y	-0,093	0,00	10,20
JETFUEL	745,25	19,75	27,25	OT 5Y	0,736	-0,01	12,80
DIESEL	707,75	19,25	24,25	OT 10Y	1,892	-0,01	6,90
COBRE	6.298,50	-10,00	248,00	BUND 10Y	0,162	3,51	20,40
ZINCO	2.565,50	62,75	23,00	SCHATZ 2Y	0,129	1,38	9,70
OURO	1.201,12	0,03	-4,44	T-NOTE 10Y	3,772	2,22	21,30
TRIGO	520,00	-7,00	-16,50	T-NOTE 2Y	3,224	1,57	17,70
LICENÇA C02	21,11	-1,32	0,42	GILT 10Y	1,760	2,36	19,20



### CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1777	0,03%	1,24%	1,1862	1,1960	1,2166
EUR/GBP	0,89425	0,04%	1,05%	0,8970	0,9001	0,9068
EUR/JPY	132,78	-0,17%	-2,73%	132,78	132,78	132,78
EUR/CHF	1,1355	-0,30%	0,79%	1,1344	1,1332	1,1309
EUR/BRL	4,8518	-0,95%	-1,73%	4,9248	5,0105	5,2157
EUR/PLN	4,2875	0,17%	-0,46%	4,3094	4,3328	4,3821



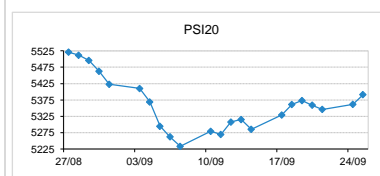
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1777	0,8943	132,78	1,1355	10,3536	7,4589	1,5234	1,62353	4,8518	9,5689
USD	0,8486	-	0,7597	112,885	0,9642	8,7922	6,3307	1,2949	1,3788	4,1289	8,1096

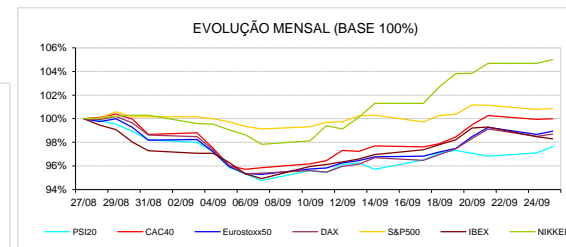
### ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	8,380	0,96	62,06
BCP	0,261	2,96	-4,12
CORT. AMORIM	11,540	1,05	12,04
CTT	3,372	0,54	-3,85
EDP	3,260	-0,15	13,00
EDP R	8,735	0,34	25,38
GALP	17,170	2,32	12,04
IBERSOL	9,380	0,64	-7,36
J MARTINS	12,630	-0,47	-22,01
MOTA ENGIL	2,115	1,93	-42,26
NAVIGATOR	4,184	-1,74	-0,86
NOS	5,165	0,29	-5,77
NOVABASE	2,680	0,37	-12,10
PHAROL	0,181	-0,66	-27,68
REN	2,422	-0,08	-2,30
SEMAPA	17,240	-0,46	-3,12
SONAE CAP.	0,756	0,40	-14,77
SONAE SGPS	0,890	-0,67	-20,96

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	2,96
GALP	2,32
MOTA ENGIL	1,93
CORT. AMORIM	1,05
ALTRI	0,96
SEMAPA	-0,46
J MARTINS	-0,47
PHAROL	-0,66
SONAE SGPS	-0,67
NAVIGATOR	-1,74



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.391,17	0,55%	0,05%	5.801,45	5.208,33
CAC40	5.479,10	0,05%	3,13%	5.657,44	5.038,12
ESTX 50 PR	3.419,78	0,27%	-2,40%	3.708,82	3.261,86
XTRA DAX	12.374,66	0,19%	-4,20%	13.596,89	11.726,62
S&P 500	2.922,19	0,10%	9,30%	2.940,91	2.488,03
IBEX 35	9.493,60	-0,20%	-5,48%	10.643,40	9.111,10
NIKKEI 225	23.940,26	0,29%	5,16%	24.129,34	20.213,66



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.