

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

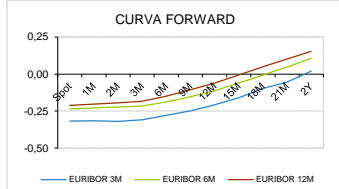
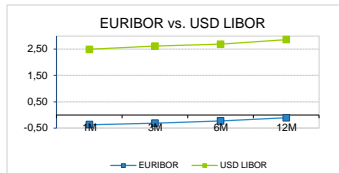
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

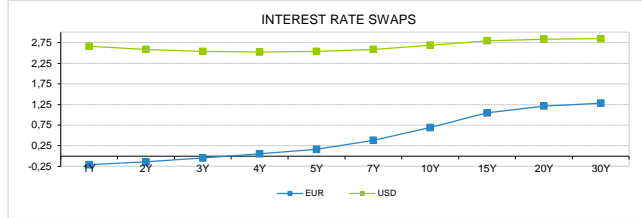
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4904	0	-1	0,7289	-0,7844
3M	-0,3100	0	0	3M	2,6151	-1	-14	0,8520	-0,7156
6M	-0,2300	0	1	6M	2,6858	0	-14	0,9938	-0,6494
12M	-0,1080	0	0	12M	2,8649	0	-17	1,1393	-0,5118

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,2110	0	1	-0,0620	0,3789	0,8490	
2Y	-0,1420	1	1	0,0472	0,4931	0,9565	
3Y	-0,0490	2	1	0,1569	0,6112	1,0645	
4Y	0,0540	3	0	0,2684	0,7230	1,1680	
5Y	0,1610	3	-1	0,3831	0,8335	1,2620	
7Y	0,3790	4	-3	0,6060	1,0365	1,4146	
10Y	0,6900	4	-4	0,9010	1,2589	1,5465	
15Y	1,0460	4	-4	1,1978	1,4405	1,6315	
20Y	1,2120	4	-3	1,3302	1,4995	1,6185	
30Y	1,2810	4	-2	1,3664	1,4698	1,5400	

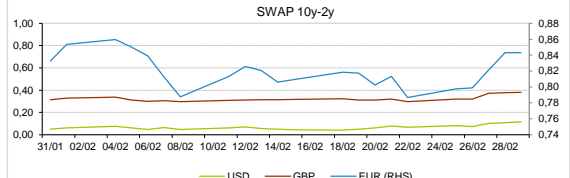
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6590	1	-12	2,5851	2,5220	2,7160
2Y	2,5850	1	-15	2,5265	2,5700	2,7962
3Y	2,5350	1	-15	2,5456	2,6442	2,8190
4Y	2,5210	2	-14	2,5676	2,6680	2,8851
5Y	2,5340	2	-14	2,6031	2,7090	2,9250
7Y	2,5860	3	-12	2,6792	2,7920	2,9475
10Y	2,6870	4	-10	2,7670	2,8770	2,9860
15Y	2,7960	4	-7	2,8805	2,9589	2,9960
20Y	2,8360	4	-6	2,8850	2,9686	2,9830
30Y	2,8440	4	-5	2,8870	2,9180	2,9450

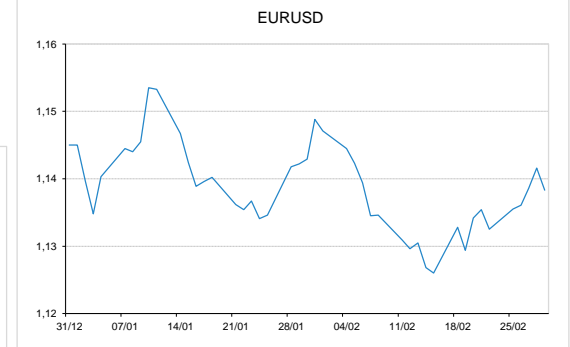
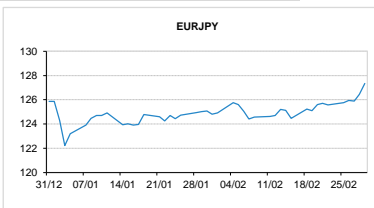
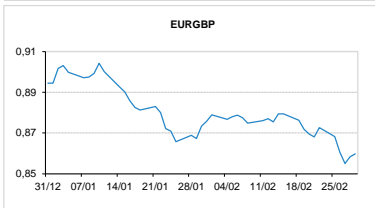


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,75	-1,56	1,96	OT 2Y	-0,247	0,00	-24,70
JETFUEL	655,00	1,25	59,50	OT 5Y	0,320	0,02	32,00
DIESEL	630,73	0,98	72,23	OT 10Y	1,490	0,02	149,00
COBRE	6.481,00	2,50	340,00	BUND 10Y	-0,391	0,00	-39,10
ZINCO	2.805,50	37,00	67,00	SCHATZ 2Y	0,092	0,69	9,20
OURO	1.300,15	-15,09	-17,55	T-NOTE 10Y	3,413	2,47	341,30
TRIGO	450,50	-9,00	-77,75	T-NOTE 2Y	2,883	4,09	288,30
LICENÇA C02	22,29	0,60	0,30	GILT 10Y	1,239	-0,93	-123,90



### CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1383	-0,29%	-0,77%	1,1471	1,1559	1,1739
EUR/GBP	0,85968	-0,15%	2,23%	0,8623	0,8652	0,8713
EUR/JPY	127,35	-0,71%	-1,92%	127,35	127,35	127,35
EUR/CHF	1,1360	-0,04%	0,41%	1,1349	1,1338	1,1313
EUR/BRL	4,3015	-0,78%	-2,63%	4,3652	4,4326	4,5676
EUR/PLN	4,3058	-0,05%	-0,38%	4,3263	4,3480	4,3927



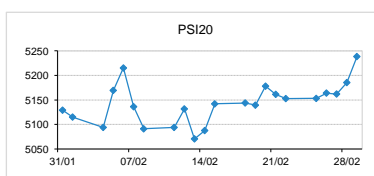
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1383	0,8597	127,35	1,1360	10,5338	7,4616	1,5103	1,60694	4,3015	9,7543
USD	0,8782	-	0,755	111,905	0,9979	9,2415	6,5532	1,3241	1,4093	3,7883	8,5632

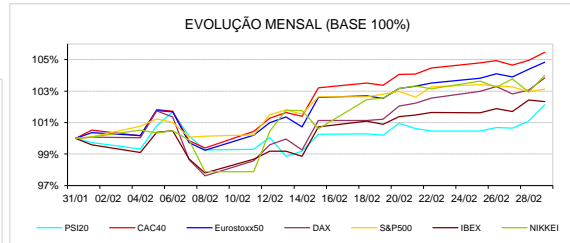
### ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,300	1,67	25,86
BCP	0,244	1,04	6,10
CORT. AMORIM	10,260	1,79	14,00
CTT	2,818	1,66	-4,34
EDP	3,236	0,34	6,13
EDP R	8,320	0,60	7,01
GALP	14,510	0,55	5,18
IBERSOL	8,060	0,50	2,03
J MARTINS	13,530	2,11	30,85
MOTA ENGIL	2,135	5,96	32,61
NAVIGATOR	4,320	0,23	20,00
NOS	5,325	1,43	0,57
NOVABASE	2,500	2,46	23,76
PHAROL	0,191	-0,52	17,03
REN	2,634	0,92	8,22
SEMAPA	15,320	-0,13	16,95
SONAE CAP.	0,864	0,23	1,77
SONAE SGPS	0,950	1,28	17,28

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	5,96
NOVABASE	2,46
J MARTINS	2,11
CORT. AMORIM	1,79
ALTRI	1,67
SEMAPA	-0,13
PHAROL	-0,52



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.238,54	1,02%	10,72%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.265,19	0,47%	11,30%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.312,10	0,42%	10,35%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.601,68	0,75%	9,88%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.789,92	0,14%	11,23%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.267,70	-0,11%	8,52%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.602,69	1,02%	7,93%	24.448,07	18.948,58



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.