

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

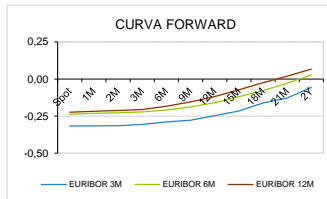
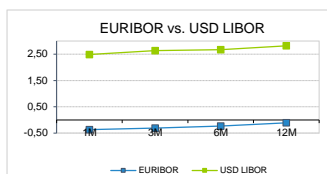
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

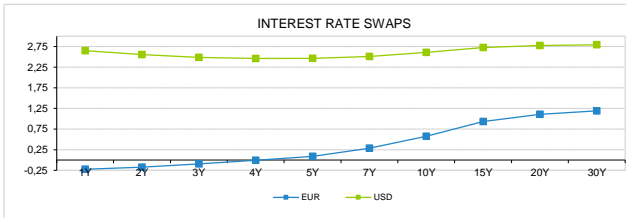
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4878	1	0	0,7320	-0,7848
3M	-0,3100	0	0	3M	2,6326	1	-1	0,8460	-0,7092
6M	-0,2320	0	0	6M	2,6706	0	-8	0,9675	-0,6494
12M	-0,1090	0	0	12M	2,8176	-2	-9	1,1129	-0,5068

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2237	0	0	-0,1200	0,2640	0,6885
2Y	-0,1740	0	-2	-0,0260	0,3670	0,7970
3Y	-0,0950	0	-2	0,0710	0,4740	0,9010
4Y	-0,0060	0	-3	0,1705	0,5810	1,0015
5Y	0,0890	-1	-4	0,2735	0,6855	1,0955
7Y	0,2870	-1	-6	0,4815	0,8800	1,2415
10Y	0,5770	-1	-8	0,7630	1,1080	1,3890
15Y	0,9330	-1	-8	1,0700	1,3051	1,4870
20Y	1,1070	-1	-7	1,2055	1,3680	1,4875
30Y	1,1920	-1	-4	1,2545	1,3530	1,4235

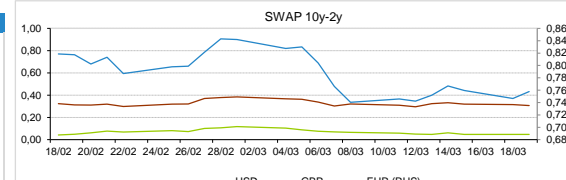
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6500	-1	-6	2,4810	2,3510	2,5565
2Y	2,5560	-2	-10	2,3930	2,3960	2,6140
3Y	2,4880	-2	-11	2,3810	2,4470	2,6620
4Y	2,4620	-3	-12	2,3960	2,4995	2,7080
5Y	2,4640	-3	-12	2,4240	2,5525	2,7680
7Y	2,5100	-3	-11	2,5060	2,6420	2,8140
10Y	2,6080	-3	-9	2,6175	2,7370	2,8610
15Y	2,7280	-2	-7	2,7270	2,8040	2,8790
20Y	2,7760	-2	-5	2,7640	2,8150	2,8710
30Y	2,7930	-2	-4	2,7740	2,8090	2,8470

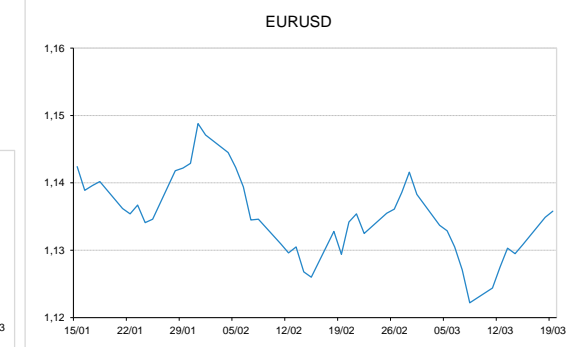
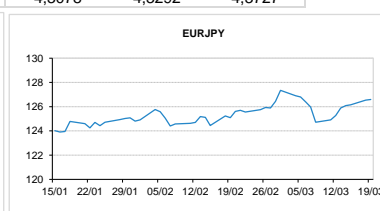


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	67,42	-0,12	0,95	OT 2Y	-0,255	0,01	-2,00
JETFUEL	640,75	-0,25	-10,50	OT 5Y	0,240	0,04	-12,20
DIESEL	608,25	0,00	-13,75	OT 10Y	1,301	0,04	-26,10
COBRE	6.433,00	-6,00	150,00	BUND 10Y	-0,291	2,55	0,00
ZINCO	2.807,50	-5,50	155,00	SCHATZ 2Y	0,090	0,92	1,70
OURO	1.306,59	3,28	-34,06	T-NOTE 10Y	3,306	0,65	-4,60
TRIGO	455,00	-1,75	-37,25	T-NOTE 2Y	2,799	1,17	-3,50
LICENÇA C02	21,15	-0,67	0,94	GILT 10Y	1,130	1,02	3,10



### CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1358	0,08%	0,57%	1,1446	1,1535	1,1712
EUR/GBP	0,85548	0,13%	1,91%	0,8582	0,8611	0,8673
EUR/JPY	126,59	-0,04%	-1,18%	126,59	126,59	126,59
EUR/CHF	1,1343	0,02%	0,11%	1,1332	1,1321	1,1299
EUR/BRL	4,2903	0,22%	-1,61%	4,3498	4,4162	4,5429
EUR/PLN	4,2869	0,06%	1,03%	4,3078	4,3292	4,3727



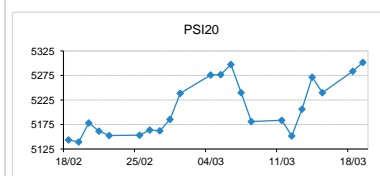
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1358	0,8555	126,59	1,1343	10,4509	7,4624	1,5112	1,6008	4,2903	9,6876
USD	0,8811	-	0,7541	111,39	0,9995	9,1929	6,5750	1,3270	1,4082	3,7845	8,5289

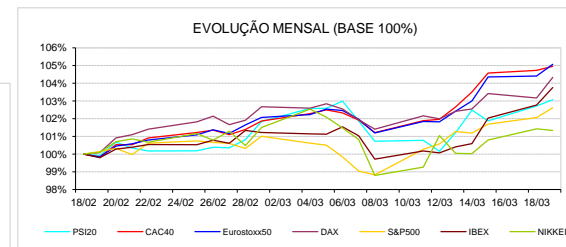
### ACCIONISTA

TITULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,340	0,00	26,55
BCP	0,231	-0,35	0,65
CORT. AMORIM	10,720	-1,11	19,11
CTT	2,772	0,51	-5,91
EDP	3,345	-0,59	9,71
EDP R	8,650	0,35	11,25
GALP	14,720	1,06	6,71
IBERSOL	8,000	0,00	1,27
J MARTINS	13,475	0,90	30,32
MOTA ENGIL	2,210	0,00	37,27
NAVIGATOR	4,310	0,56	19,72
NOS	5,655	0,18	6,80
NOVABASE	2,560	0,39	26,73
PHAROL	0,205	7,33	25,61
REN	2,650	-0,30	8,87
SEMAPA	15,200	0,93	16,03
SONAE CAP.	0,892	0,22	5,06
SONAE SGPS	0,970	1,25	19,75

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	7,33
SONAE SGPS	1,25
GALP	1,06
SEMAPA	0,93
J MARTINS	0,90
REN	-0,30
BCP	-0,35
EDP	-0,59
CORT. AMORIM	-1,11



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.300,51	0,34%	12,05%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.425,90	0,22%	14,67%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.409,41	0,63%	13,59%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.788,41	1,13%	11,65%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.848,14	0,54%	13,62%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.499,50	0,96%	11,24%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.566,85	-0,08%	7,75%	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.