

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

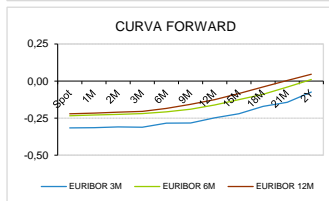
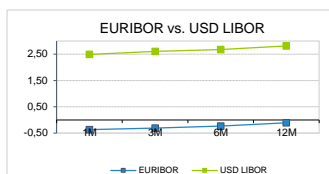
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

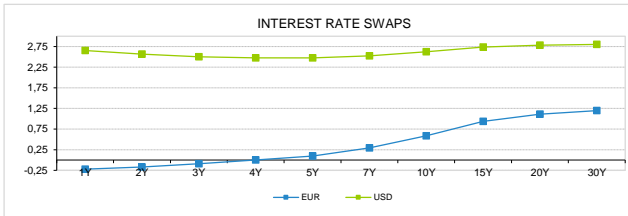
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4906	0	1	0,7296	-0,7852
3M	-0,3090	0	0	3M	2,6070	-1	-6	0,8371	-0,7084
6M	-0,2290	0	0	6M	2,6790	0	-1	0,9654	-0,6500
12M	-0,1080	0	0	12M	2,8135	0	-6	1,1131	-0,5040

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2210	0	0	-0,1277	0,2325	0,6290
2Y	-0,1700	0	0	-0,0401	0,3302	0,7360
3Y	-0,0900	1	-1	0,0513	0,4300	0,8400
4Y	0,0000	1	-1	0,1448	0,5329	0,9390
5Y	0,0950	1	-2	0,2419	0,6350	1,0300
7Y	0,2940	1	-4	0,4408	0,8270	1,1785
10Y	0,5850	2	-6	0,7167	1,0426	1,3255
15Y	0,9380	1	-6	1,0082	1,2348	1,4264
20Y	1,1110	1	-6	1,1477	1,3065	1,4303
30Y	1,1970	1	-4	1,2018	1,2979	1,3681

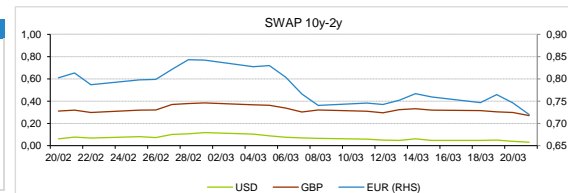
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,6530	-1	-5	2,3740	2,2610	2,4760
2Y	2,5680	0	-5	2,3048	2,3135	2,5040
3Y	2,5020	0	-6	2,2993	2,3450	2,5510
4Y	2,4760	0	-6	2,3190	2,3955	2,6396
5Y	2,4770	0	-6	2,3508	2,4445	2,6835
7Y	2,5240	0	-6	2,4130	2,5736	2,7065
10Y	2,6220	0	-4	2,5280	2,6693	2,7750
15Y	2,7380	0	-2	2,6570	2,7415	2,8040
20Y	2,7850	1	-1	2,7017	2,7420	2,8199
30Y	2,8020	1	0	2,6960	2,7280	2,7630

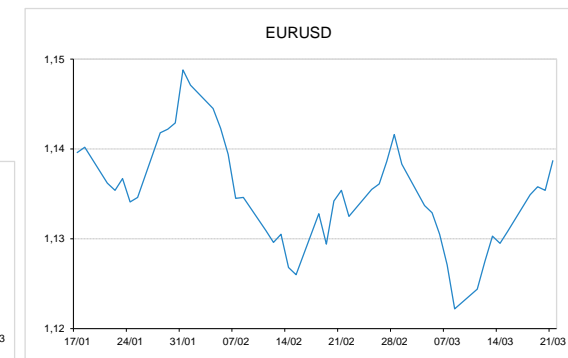
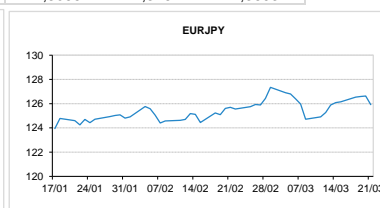


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	67,80	-0,70	0,61	OT 2Y	-0,267	-0,03	-3,00
JETFUEL	655,25	7,75	2,75	OT 5Y	0,216	-0,03	-13,50
DIESEL	621,00	5,75	-0,50	OT 10Y	1,282	-0,04	-22,50
COBRE	6.493,00	-2,00	52,00	BUND 10Y	-0,356	-4,14	-7,00
ZINCO	2.896,50	48,50	181,00	SCHATZ 2Y	0,064	-2,07	0,20
OURO	1.305,86	3,85	-21,79	T-NOTE 10Y	3,233	-0,81	-10,10
TRIGO	463,50	-1,25	-27,50	T-NOTE 2Y	2,727	0,00	-8,20
LICENÇA C02	20,95	-0,69	2,15	GILT 10Y	0,987	-8,79	-12,40



### CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1387	0,29%	0,29%	1,1475	1,1563	1,1737
EUR/GBP	0,8665	-0,43%	0,18%	0,8693	0,8721	0,8779
EUR/JPY	125,92	0,56%	-0,17%	125,92	125,92	125,92
EUR/CHF	1,1281	0,41%	0,59%	1,1271	1,1260	1,1238
EUR/BRL	4,3471	-0,81%	-1,87%	4,4081	4,4759	4,6050
EUR/PLN	4,2846	-0,05%	1,21%	4,3055	4,3267	4,3693



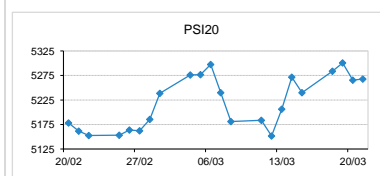
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1387	0,8665	125,92	1,1281	10,4335	7,4625	1,5194	1,59854	4,3471	9,6331
USD	0,8796	-	0,7627	110,875	0,9933	9,1596	6,5644	1,3365	1,4048	3,8106	8,4600

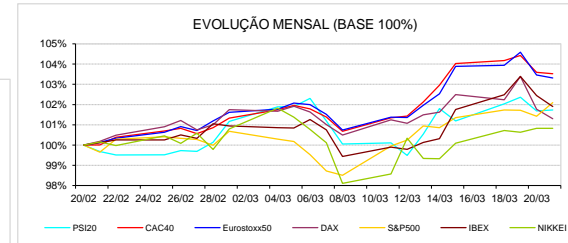
### ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	7,230	-0,41	24,66
BCP	0,227	-0,87	-1,05
CORT. AMORIM	10,700	-0,74	18,89
CTT	2,682	-2,12	-8,96
EDP	3,420	2,61	12,17
EDP R	8,675	0,87	11,58
GALP	14,235	-1,21	3,19
IBERSOL	8,020	-0,74	1,52
J MARTINS	13,475	0,71	30,32
MOTA ENGIL	2,220	0,00	37,89
NAVIGATOR	4,228	-0,75	17,44
NOS	5,630	0,09	6,33
NOVABASE	2,550	1,19	26,24
PHAROL	0,207	-2,82	26,53
REN	2,642	-0,38	8,55
SEMAPA	14,920	-0,40	13,89
SONAE CAP.	0,898	0,34	5,77
SONAE SGPS	0,981	0,67	21,11

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP	2,61
NOVABASE	1,19
EDP R	0,87
J MARTINS	0,71
SONAE SGPS	0,67
NAVIGATOR	-0,75
BCP	-0,87
GALP	-1,21
CTT	-2,12
PHAROL	-2,82



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.267,78	0,04%	11,33%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.378,85	-0,07%	13,70%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.367,40	-0,15%	12,19%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.549,96	-0,46%	9,39%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.842,77	0,67%	13,41%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.355,60	-0,53%	9,55%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.608,92	0,20%	7,96%	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.