

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

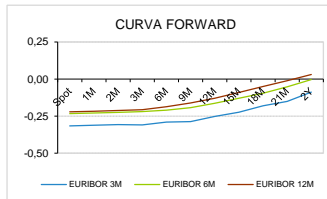
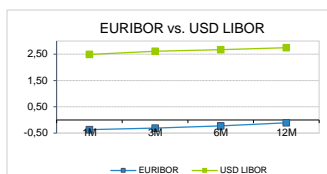
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

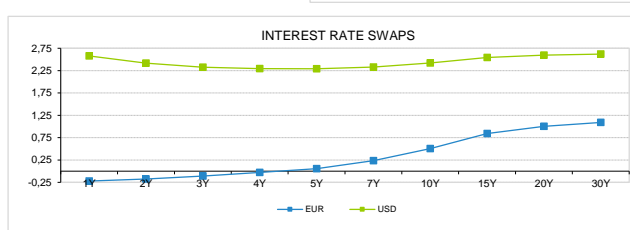
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3680	0	0	1M	2,4898	-1	1	0,7285	-0,7848
3M	-0,3090	0	0	3M	2,6088	0	-3	0,8324	-0,7046
6M	-0,2280	0	0	6M	2,6730	0	-2	0,9438	-0,6472
12M	-0,1080	0	0	12M	2,7458	-4	-14	1,0598	-0,5072

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2210	0	-1	-0,1306	0,2062	0,5740
2Y	-0,1760	0	-2	-0,0500	0,2989	0,6700
3Y	-0,1080	0	-4	0,0361	0,3909	0,7690
4Y	-0,0290	0	-6	0,1250	0,4850	0,8615
5Y	0,0550	0	-8	0,2150	0,5810	0,9470
7Y	0,2350	0	-11	0,4000	0,7580	1,0883
10Y	0,5060	-1	-14	0,6554	0,9596	1,2140
15Y	0,8410	0	-16	0,9249	1,1323	1,3020
20Y	1,0040	-1	-17	1,0503	1,1942	1,3010
30Y	1,0900	0	-15	1,0920	1,1778	1,2390

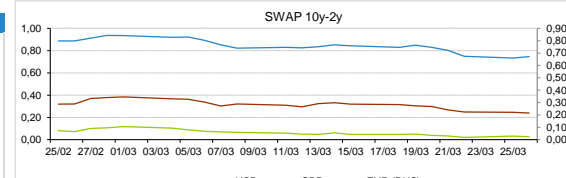
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5780	-4	-9	2,1947	2,1431	2,3440
2Y	2,4170	-8	-19	2,1070	2,1790	2,4094
3Y	2,3270	-9	-23	2,1110	2,2345	2,4390
4Y	2,2930	-10	-25	2,1420	2,2820	2,5063
5Y	2,2910	-10	-25	2,1810	2,3330	2,5516
7Y	2,3290	-10	-26	2,2660	2,4215	2,5965
10Y	2,4210	-11	-25	2,4059	2,5255	2,6530
15Y	2,5430	-11	-23	2,5070	2,6010	2,6840
20Y	2,5960	-11	-22	2,5755	2,6215	2,6790
30Y	2,6190	-11	-20	2,5765	2,6190	2,6550

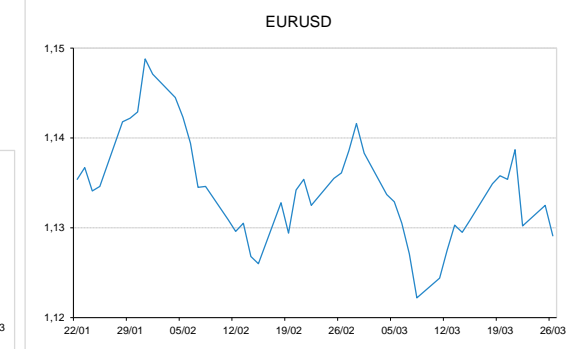
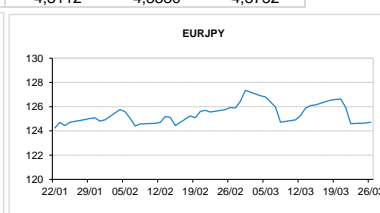


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	67,80	0,59	2,44	OT 2Y	-0,287	-0,02	-4,60
JETFUEL	646,00	9,00	6,25	OT 5Y	0,223	0,00	-9,50
DIESEL	610,25	8,50	-1,75	OT 10Y	1,292	0,00	-19,30
COBRE	6.335,00	28,00	-140,00	BUND 10Y	-0,412	0,51	-11,10
ZINCO	2.869,50	23,50	132,50	SCHATZ 2Y	0,053	0,00	-0,90
OURO	1.315,82	-6,94	-9,93	T-NOTE 10Y	3,152	0,64	-18,70
TRIGO	473,25	3,75	5,00	T-NOTE 2Y	2,611	3,10	-19,20
LICENÇA C02	21,55	0,61	1,89	GILT 10Y	0,926	1,99	-16,70



### CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1291	-0,30%	-0,62%	1,1379	1,1467	1,1633
EUR/GBP	0,8533	0,36%	0,85%	0,8561	0,8589	0,8645
EUR/JPY	124,72	-0,06%	0,97%	124,72	124,72	124,72
EUR/CHF	1,1215	0,10%	1,47%	1,1204	1,1193	1,1171
EUR/BRL	4,3666	-0,12%	-2,19%	4,4300	4,5019	4,6331
EUR/PLN	4,2900	0,07%	0,86%	4,3112	4,3330	4,3752



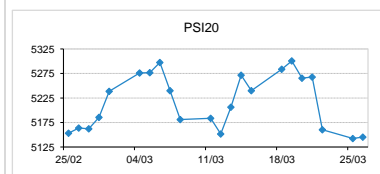
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1291	0,8533	124,72	1,1215	10,4145	7,4654	1,5102	1,58035	4,3666	9,6277
USD	0,8851	-	0,7556	110,59	0,9943	9,2183	6,6075	1,3386	1,4011	3,8693	8,5271

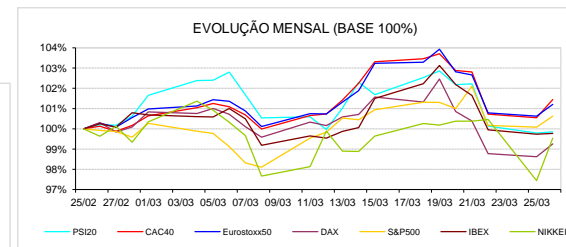
### ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	6,760	-3,15	16,55
BCP	0,221	-0,99	-3,83
CORT. AMORIM	10,560	0,19	17,33
CTT	2,588	-1,22	-12,15
EDP	3,475	0,87	13,97
EDP R	8,430	-1,06	8,42
GALP	14,075	1,59	2,03
IBERSOL	8,080	1,00	2,28
J MARTINS	13,100	-0,27	26,69
MOTA ENGIL	2,055	0,00	27,64
NAVIGATOR	4,020	-0,74	11,67
NOS	5,665	1,89	6,99
NOVABASE	2,520	0,40	24,75
PHAROL	0,186	-2,10	14,22
REN	2,554	-0,55	4,93
SEMAPA	14,380	-1,10	9,77
SONAE CAP.	0,877	-0,45	3,30
SONAE SGPS	0,917	0,66	13,21

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOS	1,89
GALP	1,59
IBERSOL	1,00
EDP	0,87
SONAE SGPS	0,66
EDP R	-1,06
SEMAPA	-1,10
CTT	-1,22
PHAROL	-2,10
ALTRI	-3,15



INDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.145,28	0,06%	8,75%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.307,38	0,89%	12,19%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.319,53	0,58%	10,60%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.419,48	0,64%	8,15%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.813,60	0,54%	12,23%	2.940,91	2.346,58
IBEX 35	9.183,10	0,03%	7,53%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.428,39	2,15%	7,06%	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.