

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

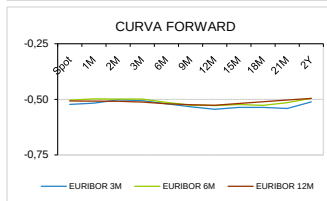
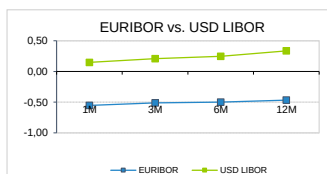
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

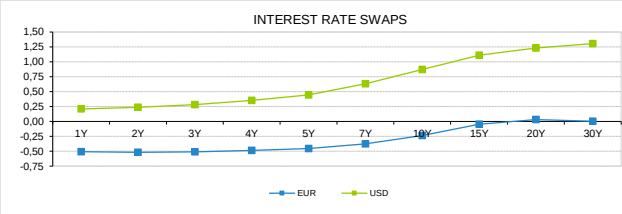
| INTERBANK OFFERED RATES |         |          |          |           |            |          |          |           |           |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M                      | -0,5530 | -1       | -3       | 1M        | 0,1479     | 0        | 0        | 0,0456    | -0,7986   |
| 3M                      | -0,5110 | 0        | 0        | 3M        | 0,2091     | -1       | -1       | 0,0481    | -0,7746   |
| 6M                      | -0,4980 | 0        | -3       | 6M        | 0,2460     | -1       | -3       | 0,0683    | -0,7312   |
| 12M                     | -0,4670 | 0        | -3       | 12M       | 0,3349     | 0        | -4       | 0,1219    | -0,6154   |

| INTEREST RATE SWAPS |         |          |          |         |         |         |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|---------|---------|
| EUR                 | LAST    | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y      | 3Y      | 5Y      |
| 1Y                  | -0,5074 | 0        | -2       | -0,5274 | -0,4129 | -0,2341 |
| 2Y                  | -0,5180 | 0        | -3       | -0,5121 | -0,3700 | -0,1810 |
| 3Y                  | -0,5111 | 0        | -3       | -0,4791 | -0,3250 | -0,1290 |
| 4Y                  | -0,4861 | 1        | -2       | -0,4410 | -0,2750 | -0,0780 |
| 5Y                  | -0,4539 | 1        | -2       | -0,3990 | -0,2250 | -0,0231 |
| 7Y                  | -0,3749 | 1        | -1       | -0,3060 | -0,1230 | 0,0620  |
| 10Y                 | -0,2373 | 2        | -1       | -0,1615 | 0,0055  | 0,1525  |
| 15Y                 | -0,0470 | 2        | 0        | 0,0066  | 0,1099  | 0,1910  |
| 20Y                 | 0,0313  | 3        | 0        | 0,0602  | 0,1148  | 0,1515  |
| 30Y                 | 0,0040  | 3        | 0        | 0,0125  | 0,0321  | 0,0414  |

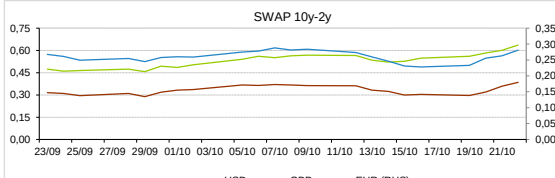
| TAXA DE REFERÊNCIA<br>BANCO CENTRAL |       |
|-------------------------------------|-------|
| Zona Euro                           | 0,00  |
| EUA                                 | 0,25  |
| Reino Unido                         | 0,10  |
| Japão                               | 0,10  |
| Canadá                              | 0,25  |
| Suíça                               | -0,75 |
| China                               | 5,75  |
| Brasil                              | 2,00  |
| Austrália                           | 0,25  |
| Índia                               | 3,00  |



| INTEREST RATE SWAPS |        |          |          | FORWARDS |        |        |
|---------------------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|
| USD                 | LAST   | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y       | 3Y     | 5Y     |
| 1Y                  | 0,2095 | 0        | -2       | 0,2572   | 0,5524 | 1,0030 |
| 2Y                  | 0,2362 | 0        | 2        | 0,3118   | 0,6905 | 1,0845 |
| 3Y                  | 0,2810 | 1        | 6        | 0,3975   | 0,7830 | 1,1790 |
| 4Y                  | 0,3531 | 1        | 9        | 0,4755   | 0,8720 | 1,2656 |
| 5Y                  | 0,4440 | 2        | 12       | 0,6043   | 0,9675 | 1,3206 |
| 7Y                  | 0,6313 | 3        | 16       | 0,7850   | 1,1085 | 1,3765 |
| 10Y                 | 0,8722 | 4        | 20       | 0,9960   | 1,2550 | 1,4445 |
| 15Y                 | 1,1116 | 4        | 22       | 1,1860   | 1,3670 | 1,4975 |
| 20Y                 | 1,2327 | 5        | 23       | 1,2795   | 1,4070 | 1,4970 |
| 30Y                 | 1,3058 | 5        | 24       | 1,3440   | 1,4150 | 1,4534 |

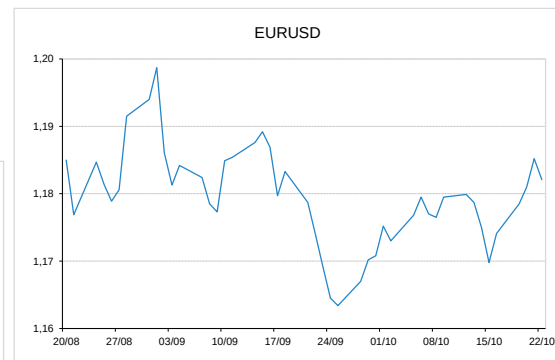
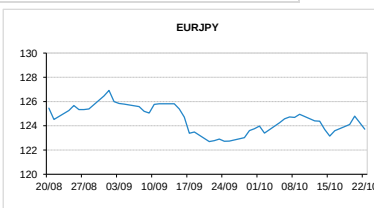
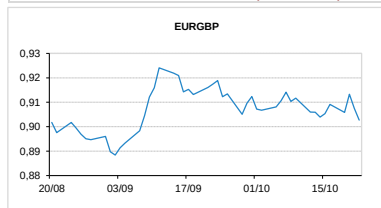


| COMMODITIES | LAST     | Var. 1D | Var. 1M | BONDS      | YIELD  | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT       | 42,67    | 0,94    | 0,48    | OT 2Y      | -0,547 | 0,02     | 5,60     |
| JETFUEL     | 338,58   | 2,57    | 11,59   | OT 5Y      | -0,290 | 0,02     | -2,70    |
| DIESEL      | 341,25   | 2,00    | 2,75    | OT 10Y     | 0,203  | 0,02     | -5,50    |
| COBRE       | 6.996,00 | 92,50   | 300,00  | BUND 10Y   | -1,086 | 2,89     | -6,20    |
| ZINCO       | 2.559,25 | 40,25   | 107,75  | SCHATZ 2Y  | -0,185 | 1,14     | -3,60    |
| OURO        | 1.901,80 | -23,24  | 2,40    | T-NOTE 10Y | 1,797  | 2,40     | 11,80    |
| TRIGO       | 627,25   | -2,50   | 69,25   | T-NOTE 2Y  | 0,746  | 0,56     | 2,70     |
| LICENÇA C02 | 24,04    | 0,48    | -3,81   | GILT 10Y   | 0,388  | 4,80     | 8,30     |



### CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING  | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M  | FW 6M  | FW 12M |
|---------|---------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,1821  | -0,26%  | 0,69%   | 1,1847 | 1,1870 | 1,1919 |
| EUR/GBP | 0,90273 | 0,53%   | 1,63%   | 0,9041 | 0,9055 | 0,9084 |
| EUR/JPY | 123,72  | 0,44%   | -0,76%  | 123,72 | 123,72 | 123,72 |
| EUR/CHF | 1,0730  | 0,07%   | 0,41%   | 1,0723 | 1,0716 | 1,0703 |
| EUR/BRL | 6,6017  | 0,74%   | -2,91%  | 6,6384 | 6,6724 | 6,7819 |
| EUR/PLN | 4,5714  | 0,00%   | -1,81%  | 4,5807 | 4,5890 | 4,6058 |



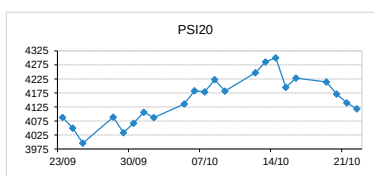
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

|     | EUR    | USD    | GBP    | JPY     | CHF    | SEK     | DKK    | CAD    | AUD    | BRL    | NOK     |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|--------|--------|---------|
| EUR | -      | 1,1821 | 0,9027 | 123,72  | 1,0730 | 10,3770 | 7,4405 | 1,5531 | 1,663  | 6,6017 | 10,9251 |
| USD | 0,8455 | -      | 0,7638 | 104,805 | 0,9070 | 8,7626  | 6,2908 | 1,3128 | 1,4068 | 5,5777 | 9,2136  |

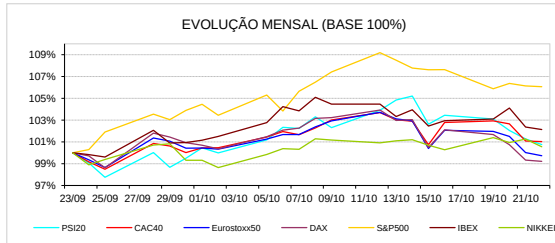
### ACCIONISTA

| TÍTULO       | COTACÃO | 1D %  | YTD %  |
|--------------|---------|-------|--------|
| ALTRI        | 3,554   | -1,33 | -37,43 |
| BCP          | 0,076   | -1,16 | -62,33 |
| CORT. AMORIM | 10,320  | 0,58  | -8,67  |
| CTT          | 2,320   | 0,87  | -27,27 |
| EDP          | 4,393   | -0,48 | 16,33  |
| EDP R        | 16,100  | -3,01 | 53,33  |
| GALP         | 8,010   | 1,88  | -46,24 |
| IBERSOL      | 3,860   | 0,00  | -51,75 |
| J MARTINS    | 14,375  | -1,34 | -1,98  |
| MOTA ENGIL   | 1,170   | 2,45  | -37,43 |
| NAVIGATOR    | 1,970   | -0,76 | -42,87 |
| NOS          | 3,074   | 1,12  | -35,96 |
| PHAROL       | 0,096   | 0,84  | -3,61  |
| RAMADA       | 2,990   | 0,34  | -48,80 |
| REN          | 2,365   | -0,63 | -13,05 |
| SEMAPA       | 6,790   | -2,44 | -50,51 |
| SONAE CAP.   | 0,770   | 10,00 | 2,26   |
| SONAE SGPS   | 0,519   | 0,19  | -42,97 |

| MAIORES GANHOS/PERDAS |            |
|-----------------------|------------|
| Título                | Variação % |
| SONAE CAP.            | 10,00      |
| MOTA ENGIL            | 2,45       |
| GALP                  | 1,88       |
| NOS                   | 1,12       |
| CTT                   | 0,87       |
| BCP                   | -1,16      |
| ALTRI                 | -1,33      |
| J MARTINS             | -1,34      |
| SEMAPA                | -2,44      |
| EDP R                 | -3,01      |



| ÍNDICE     | LAST      | Var. 1D | YTD%    | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|---------|-----------|-----------|
| PSI 20     | 4.118,13  | -0,52%  | -21,02% | 5.454,21  | 3.500,02  |
| CAC40      | 4.851,38  | -0,05%  | -18,85% | 6.111,41  | 3.632,06  |
| ESTX 50 PR | 3.171,41  | -0,29%  | -15,32% | 3.867,28  | 2.302,84  |
| XTRA DAX   | 12.543,06 | -0,12%  | -5,33%  | 13.795,24 | 8.255,65  |
| S&P 500    | 3.432,27  | -0,07%  | 6,26%   | 3.588,11  | 2.191,86  |
| IBEX 35    | 6.796,60  | -0,22%  | -28,83% | 10.100,20 | 5.814,50  |
| NIKKEI 225 | 23.474,27 | -0,70%  | -0,77%  | 24.115,95 | 16.358,19 |



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.