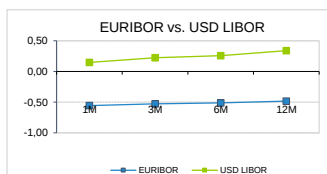


## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

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

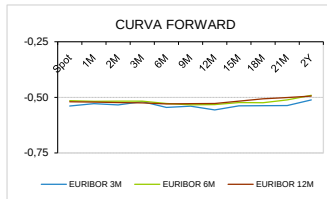
### RENTA FIXA

| INTERBANK OFFERED RATES |         |          |          |           |            |          |          |           |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|
| EURIBOR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR |
| 1M                      | -0,5560 | -1       | -2       | 1M        | 0,1465     | 0        | 0        | 0,0440    |
| 3M                      | -0,5270 | 0        | -2       | 3M        | 0,2238     | -1       | 1        | 0,0479    |
| 6M                      | -0,5120 | 0        | -2       | 6M        | 0,2569     | 0        | 0        | 0,0605    |
| 12M                     | -0,4830 | 0        | -1       | 12M       | 0,3388     | 0        | 0        | 0,1319    |

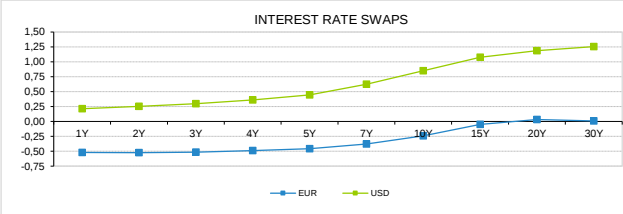


| INTEREST RATE SWAPS |         |          |          |         |         |         |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|---------|---------|
| EUR                 | LAST    | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y      | 3Y      | 5Y      |
| 1Y                  | -0,5203 | 0        | -1       | -0,5300 | -0,4190 | -0,2358 |
| 2Y                  | -0,5242 | 0        | 1        | -0,5130 | -0,3730 | -0,1857 |
| 3Y                  | -0,5142 | -1       | 1        | -0,4799 | -0,3280 | -0,1318 |
| 4Y                  | -0,4894 | -1       | 2        | -0,4418 | -0,2800 | -0,0797 |
| 5Y                  | -0,4574 | -1       | 3        | -0,4005 | -0,2300 | -0,0310 |
| 7Y                  | -0,3795 | -1       | 4        | -0,3084 | -0,1270 | 0,0622  |
| 10Y                 | -0,2419 | -2       | 6        | -0,1638 | 0,0038  | 0,1547  |
| 15Y                 | -0,0492 | -2       | 7        | 0,0041  | 0,1088  | 0,1962  |
| 20Y                 | 0,0320  | -2       | 7        | 0,0608  | 0,1169  | 0,1599  |
| 30Y                 | 0,0080  | -2       | 8        | 0,0190  | 0,0390  | 0,0501  |

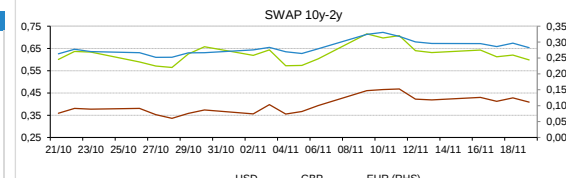
| TAXA DE REFERÊNCIA<br>BANCO CENTRAL |       |
|-------------------------------------|-------|
| Zona Euro                           | 0,00  |
| EUA                                 | 0,25  |
| Reino Unido                         | 0,10  |
| Japão                               | 0,10  |
| Canadá    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



| INTEREST RATE SWAPS |        |          |          | FORWARDS |        |        |
|---------------------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|
| USD                 | LAST   | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y       | 3Y     | 5Y     |
| 1Y                  | 0,2134 | -1       | 1        | 0,2809   | 0,5559 | 0,9790 |
| 2Y                  | 0,2516 | -1       | 2        | 0,3324   | 0,6728 | 1,0690 |
| 3Y                  | 0,2963 | -1       | 3        | 0,4092   | 0,7680 | 1,1510 |
| 4Y                  | 0,3609 | -1       | 4        | 0,5009   | 0,8640 | 1,2130 |
| 5Y                  | 0,4452 | -2       | 4        | 0,5981   | 0,9530 | 1,2764 |
| 7Y                  | 0,6245 | -2       | 6        | 0,7730   | 1,0830 | 1,3350 |
| 10Y                 | 0,8504 | -3       | 6        | 0,9700   | 1,2160 | 1,3990 |
| 15Y                 | 1,0757 | -3       | 6        | 1,1550   | 1,3240 | 1,4680 |
| 20Y                 | 1,1881 | -3       | 6        | 1,2543   | 1,3778 | 1,4450 |
| 30Y                 | 1,2556 | -4       | 6        | 1,2938   | 1,3578 | 1,3980 |

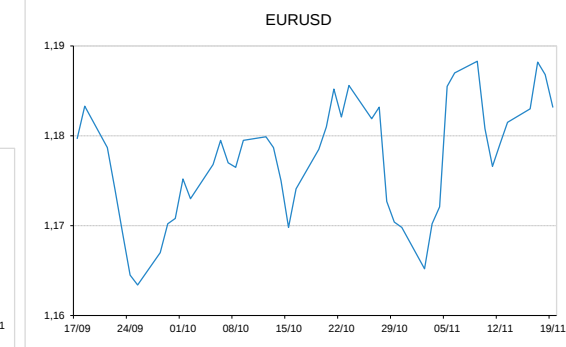
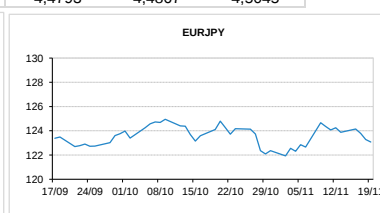
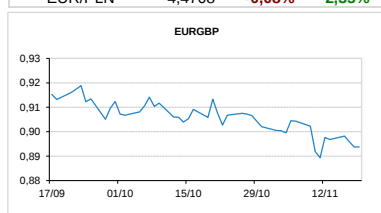


| COMMODITIES | LAST     | Var. 1D | Var. 1M | BONDS      | YIELD  | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT       | 43,99    | -0,35   | 1,01    | OT 2Y      | -0,665 | 0,00     | -8,60    |
| JETFUEL     | 367,00   | 6,00    | 24,83   | OT 5Y      | -0,418 | 0,01     | -9,60    |
| DIESEL      | 359,50   | 4,75    | 13,42   | OT 10Y     | 0,035  | -0,02    | -12,70   |
| COBRE       | 7.069,00 | 20,50   | 348,50  | BUND 10Y   | -1,086 | -1,08    | 3,50     |
| ZINCO       | 2.738,50 | 59,05   | 306,50  | SCHATZ 2Y  | -0,144 | -0,23    | 6,00     |
| OURO        | 1.859,64 | -15,77  | -50,10  | T-NOTE 10Y | 1,794  | -1,41    | 3,20     |
| TRIGO       | 602,00   | -4,50   | -24,00  | T-NOTE 2Y  | 0,761  | -0,56    | 2,40     |
| LICENÇA C02 | 26,41    | -0,78   | 1,43    | GILT 10Y   | 0,428  | -0,86    | 13,00    |



### CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING  | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M  | FW 6M  | FW 12M |
|---------|---------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,1832  | -0,30%  | 0,40%   | 1,1860 | 1,1883 | 1,1933 |
| EUR/GBP | 0,89378 | -0,01%  | 1,35%   | 0,8952 | 0,8966 | 0,8995 |
| EUR/JPY | 123,08  | 0,16%   | 0,84%   | 123,08 | 123,08 | 123,08 |
| EUR/CHF | 1,0799  | -0,01%  | -0,77%  | 1,0792 | 1,0785 | 1,0772 |
| EUR/BRL | 6,2932  | 1,00%   | 4,84%   | 6,3235 | 6,3575 | 6,4807 |
| EUR/PLN | 4,4708  | -0,08%  | 2,35%   | 4,4793 | 4,4867 | 4,5045 |



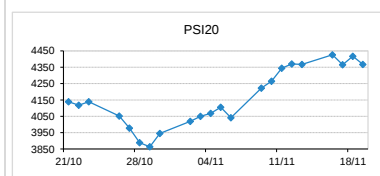
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

|     | EUR    | USD    | GBP    | JPY     | CHF    | SEK     | DKK    | CAD    | AUD     | BRL    | NOK     |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|---------|
| EUR | -      | 1,1832 | 0,8938 | 123,08  | 1,0799 | 10,2196 | 7,4517 | 1,5494 | 1,63024 | 6,2932 | 10,6917 |
| USD | 0,8446 | -      | 0,7561 | 103,885 | 0,9121 | 8,6343  | 6,2937 | 1,3087 | 1,3756  | 5,3112 | 9,0357  |

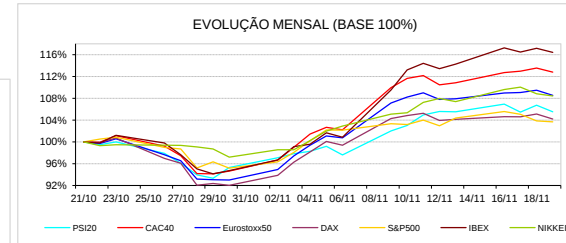
### ACCIONISTA

| TÍTULO       | COTACÃO | 1D %  | YTD %  |
|--------------|---------|-------|--------|
| ALTRI        | 3,962   | -2,41 | -30,25 |
| BCP          | 0,110   | -3,00 | -45,71 |
| CORT. AMORIM | 10,040  | -2,33 | -11,15 |
| CTT          | 2,340   | -1,27 | -26,65 |
| EDP          | 4,449   | -0,11 | 17,81  |
| EDP R        | 17,260  | 1,05  | 64,38  |
| GALP         | 8,820   | -1,89 | -40,81 |
| IBERSOL      | 4,400   | -0,68 | -45,00 |
| J MARTINS    | 13,915  | -0,43 | -5,11  |
| MOTA ENGIL   | 1,342   | -4,69 | -28,24 |
| NAVIGATOR    | 2,248   | -1,75 | -34,81 |
| NOS          | 2,782   | -2,39 | -42,04 |
| PHAROL       | 0,105   | -2,77 | 5,82   |
| RAMADA       | 3,370   | -0,88 | -42,29 |
| REN          | 2,220   | -0,67 | -18,38 |
| SEMAPA       | 7,920   | -2,10 | -42,27 |
| SONAE CAP.   | 0,770   | -0,26 | 2,26   |
| SONAE SGPS   | 0,610   | -2,01 | -32,97 |

| MAIORES GANHOS/PERDAS |            |
|-----------------------|------------|
| Título                | Variação % |
| EDP R                 | 1,05       |
| NOS                   | -2,39      |
| ALTRI                 | -2,41      |
| PHAROL                | -2,77      |
| BCP                   | -3,00      |
| MOTA ENGIL            | -4,69      |



| ÍNDICE     | LAST      | Var. 1D | YTD%    | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|---------|-----------|-----------|
| PSI 20     | 4.367,51  | -1,14%  | -16,24% | 5.454,21  | 3.500,02  |
| CAC40      | 5.474,66  | -0,67%  | -8,42%  | 6.111,41  | 3.632,06  |
| ESTX 50 PR | 3.451,97  | -0,87%  | -7,83%  | 3.867,28  | 2.302,84  |
| XTRA DAX   | 13.086,16 | -0,88%  | -1,23%  | 13.795,24 | 8.255,65  |
| S&P 500    | 3.561,54  | -0,18%  | 10,23%  | 3.645,99  | 2.191,86  |
| IBEX 35    | 7.930,20  | -0,64%  | -16,95% | 10.100,20 | 5.814,50  |
| NIKKEI 225 | 25.634,34 | -0,36%  | 8,36%   | 26.057,30 | 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.