

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

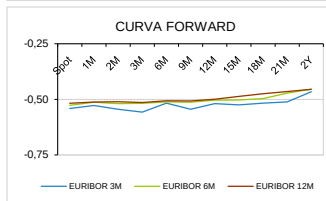
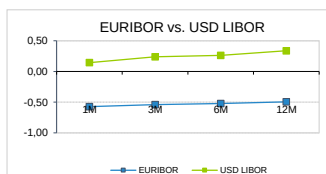
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

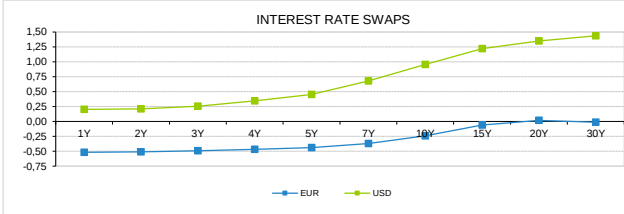
| INTERBANK OFFERED RATES |         |          |          |           |            |          |          |           |           |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M                      | -0,5730 | 0        | -3       | 1M        | 0,1433     | 0        | -1       | 0,0209    | -0,8652   |
| 3M                      | -0,5410 | 0        | -2       | 3M        | 0,2381     | -1       | 3        | 0,0274    | -0,7954   |
| 6M                      | -0,5210 | 0        | -1       | 6M        | 0,2628     | 0        | 1        | 0,0306    | -0,7426   |
| 12M                     | -0,4950 | 0        | -1       | 12M       | 0,3373     | 0        | 0        | 0,0879    | -0,6188   |

| INTEREST RATE SWAPS |         |          |          |         |         |         |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|---------|---------|
| EUR                 | LAST    | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y      | 3Y      | 5Y      |
| 1Y                  | -0,5174 | 0        | 0        | -0,4997 | -0,4039 | -0,2500 |
| 2Y                  | -0,5090 | 1        | 1        | -0,4770 | -0,3621 | -0,1988 |
| 3Y                  | -0,4909 | 1        | 2        | -0,4501 | -0,3241 | -0,1474 |
| 4Y                  | -0,4670 | 2        | 2        | -0,4194 | -0,2805 | -0,0980 |
| 5Y                  | -0,4390 | 2        | 2        | -0,3850 | -0,2362 | -0,0448 |
| 7Y                  | -0,3700 | 2        | 1        | -0,3043 | -0,1380 | 0,0390  |
| 10Y                 | -0,2420 | 2        | 1        | -0,1683 | -0,0130 | 0,1280  |
| 15Y                 | -0,0590 | 3        | -1       | -0,0089 | 0,0876  | 0,1699  |
| 20Y                 | 0,0175  | 3        | -2       | 0,0436  | 0,0924  | 0,1297  |
| 30Y                 | -0,0140 | 3        | -3       | -0,0072 | 0,0070  | 0,0136  |

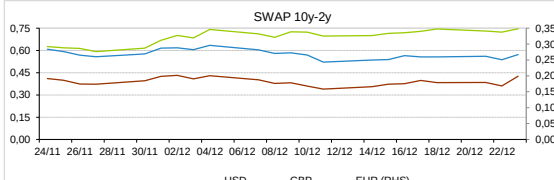
| TAXA DE REFERÊNCIA<br>BANCO CENTRAL |       |
|-------------------------------------|-------|
| Zona Euro                           | 0,00  |
| EUA                                 | 0,25  |
| Reino Unido                         | 0,10  |
| Japão                               | 0,10  |
| Canadá                              | 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                  | 0,2021 | 1        | -1       | 0,2198   | 0,5910 | 1,1632 |
| 2Y                  | 0,2099 | 1        | -4       | 0,2760   | 0,7420 | 1,2470 |
| 3Y                  | 0,2548 | 1        | -4       | 0,3795   | 0,8750 | 1,3450 |
| 4Y                  | 0,3445 | 1        | -2       | 0,5128   | 1,0050 | 1,4222 |
| 5Y                  | 0,4528 | 1        | 0        | 0,6437   | 1,0990 | 1,4846 |
| 7Y                  | 0,6796 | 2        | 5        | 0,8648   | 1,2674 | 1,5540 |
| 10Y                 | 0,9557 | 3        | 11       | 1,1137   | 1,4217 | 1,6220 |
| 15Y                 | 1,2212 | 4        | 16       | 1,3270   | 1,5381 | 1,6670 |
| 20Y                 | 1,3489 | 4        | 18       | 1,4255   | 1,5811 | 1,6894 |
| 30Y                 | 1,4365 | 4        | 20       | 1,4700   | 1,5668 | 1,6191 |

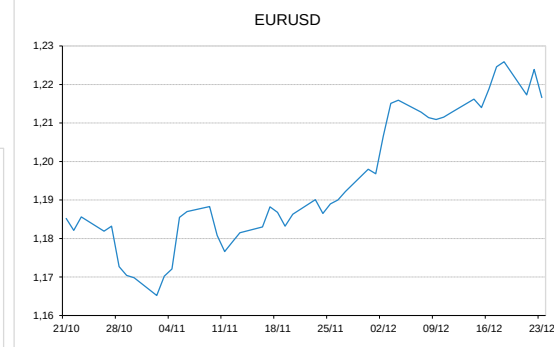
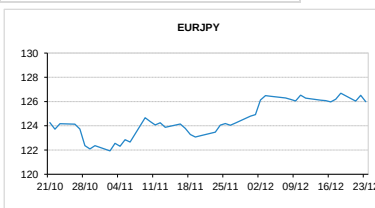


| COMMODITIES | LAST     | Var. 1D | Var. 1M | BONDS      | YIELD  | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT       | 51,32    | 1,24    | 5,28    | OT 2Y      | -0,730 | 0,01     | -6,20    |
| JETFUEL     | 432,25   | -5,50   | 61,50   | OT 5Y      | -0,431 | 0,02     | 0,30     |
| DIESEL      | 417,50   | -4,54   | 53,25   | OT 10Y     | 0,057  | 0,02     | 3,20     |
| COBRE       | 7.746,00 | -100,00 | 469,00  | BUND 10Y   | -1,211 | 5,16     | 4,10     |
| ZINCO       | 2.755,75 | -61,75  | -34,75  | SCHATZ 2Y  | -0,117 | 2,51     | 5,50     |
| OURO        | 1.874,29 | 6,56    | 34,47   | T-NOTE 10Y | 1,852  | 2,56     | 2,00     |
| TRIGO       | 630,75   | 13,75   | 26,25   | T-NOTE 2Y  | 0,717  | 0,37     | -4,20    |
| LICENÇA C02 | 31,94    | 0,79    | 4,53    | GILT 10Y   | 0,483  | 11,21    | -2,20    |



### CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M  | FW 6M  | FW 12M |
|---------|--------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,2166 | -0,60%  | 2,23%   | 1,2198 | 1,2223 | 1,2272 |
| EUR/GBP | 0,907  | 0,49%   | -2,00%  | 0,9084 | 0,9098 | 0,9126 |
| EUR/JPY | 125,99 | 0,42%   | -2,00%  | 125,99 | 125,99 | 125,99 |
| EUR/CHF | 1,0833 | -0,08%  | -0,30%  | 1,0826 | 1,0818 | 1,0804 |
| EUR/BRL | 6,3533 | -1,21%  | 1,25%   | 6,3586 | 6,3939 | 6,5112 |
| EUR/PLN | 4,5078 | -0,02%  | -0,77%  | 4,5165 | 4,5254 | 4,5448 |



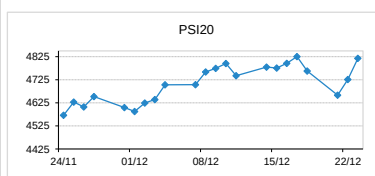
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

|     | EUR    | USD    | GBP    | JPY     | CHF    | SEK     | DKK    | CAD    | AUD     | BRL    | NOK     |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|---------|
| EUR | -      | 1,2166 | 0,9070 | 125,99  | 1,0833 | 10,1098 | 7,4376 | 1,5672 | 1,60827 | 6,3533 | 10,5333 |
| USD | 0,8207 | -      | 0,7398 | 103,595 | 0,8896 | 8,2963  | 6,1038 | 1,2863 | 1,3197  | 5,2005 | 8,6555  |

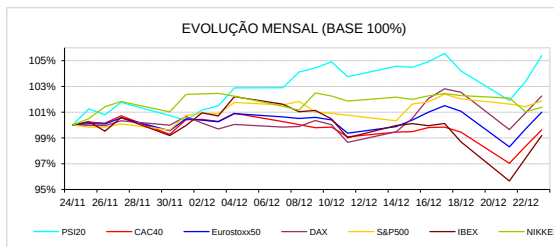
### ACCIONISTA

| TÍTULO       | COTACÃO | 1D %  | YTD %  |
|--------------|---------|-------|--------|
| ALTRI        | 5,110   | -0,49 | -10,04 |
| BCP          | 0,122   | 2,35  | -39,94 |
| CORT. AMORIM | 10,360  | 0,58  | -8,32  |
| CTT          | 2,365   | 0,64  | -25,86 |
| EDP          | 5,116   | 2,83  | 35,47  |
| EDP R        | 22,050  | 5,00  | 110,00 |
| GALP         | 8,634   | 3,30  | -42,05 |
| IBERSOL      | 5,440   | -0,37 | -32,00 |
| J MARTINS    | 13,715  | -0,40 | -5,59  |
| MOTA ENGIL   | 1,376   | 0,29  | -26,42 |
| NAVIGATOR    | 2,464   | 0,08  | -24,47 |
| NOVABASE     | 3,170   | -0,31 | 22,87  |
| NOS          | 2,850   | 0,00  | -40,63 |
| PHAROL       | 0,129   | -1,22 | 29,72  |
| REN          | 2,370   | 1,07  | -12,87 |
| SEMAPA       | 8,970   | -0,66 | -34,62 |
| SONAE SGPS   | 0,650   | 0,15  | -28,57 |

| MAIORES GANHOS/PERDAS |           |
|-----------------------|-----------|
| Título                | Varição % |
| EDP R                 | 5,00      |
| GALP                  | 3,30      |
| EDP                   | 2,83      |
| BCP                   | 2,35      |
| REN                   | 1,07      |
| IBERSOL               | -0,37     |
| J MARTINS             | -0,40     |
| ALTRI                 | -0,49     |
| SEMAPA                | -0,66     |
| PHAROL                | -1,22     |



| ÍNDICE     | LAST      | Var. 1D | YTD%    | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|---------|-----------|-----------|
| PSI 20     | 4.817,67  | 1,94%   | -7,60%  | 5.454,21  | 3.500,02  |
| CAC40      | 5.537,55  | 1,29%   | -7,37%  | 6.111,41  | 3.632,06  |
| ESTX 50 PR | 3.543,16  | 1,31%   | -5,39%  | 3.867,28  | 2.302,84  |
| XTRA DAX   | 13.592,66 | 1,30%   | 2,59%   | 13.795,24 | 8.255,65  |
| S&P 500    | 3.703,59  | 0,45%   | 14,64%  | 3.726,70  | 2.191,86  |
| IBEX 35    | 8.077,00  | 1,80%   | -15,42% | 10.100,20 | 5.814,50  |
| NIKKEI 225 | 26.524,79 | 0,33%   | 12,12%  | 26.905,67 | 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.