

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

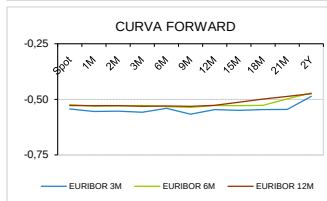
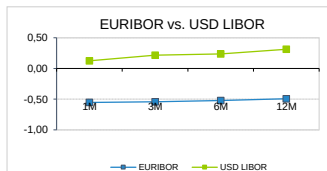
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

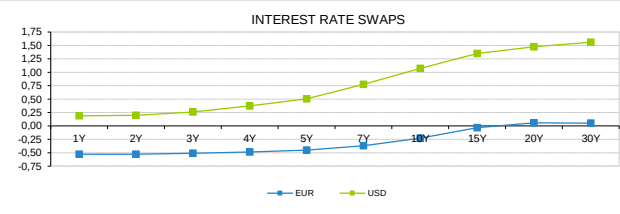
| INTERBANK OFFERED RATES |         |          |          |           |            |          |          |           |           |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M                      | -0,5540 | 0        | 1        | 1M        | 0,1248     | -1       | -2       | 0,0276    | -0,8084   |
| 3M                      | -0,5430 | 0        | 0        | 3M        | 0,2153     | 0        | -2       | 0,0354    | -0,7640   |
| 6M                      | -0,5210 | 0        | 0        | 6M        | 0,2360     | 0        | -3       | 0,0435    | -0,7222   |
| 12M                     | -0,4930 | 1        | 0        | 12M       | 0,3123     | 0        | -3       | 0,0824    | -0,6084   |

| INTEREST RATE SWAPS |         |          |          |         |         |         |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|---------|---------|
| EUR                 | LAST    | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y      | 3Y      | 5Y      |
| 1Y                  | -0,5278 | 0        | -1       | -0,5268 | -0,4151 | -0,2175 |
| 2Y                  | -0,5272 | -1       | -2       | -0,5005 | -0,3671 | -0,1660 |
| 3Y                  | -0,5095 | -1       | -2       | -0,4723 | -0,3169 | -0,1145 |
| 4Y                  | -0,4860 | -2       | -2       | -0,4340 | -0,2659 | -0,0601 |
| 5Y                  | -0,4525 | -2       | -2       | -0,3904 | -0,2152 | -0,0090 |
| 7Y                  | -0,3700 | -2       | 0        | -0,2962 | -0,1102 | 0,0813  |
| 10Y                 | -0,2293 | -3       | 1        | -0,1499 | 0,0235  | 0,1753  |
| 15Y                 | -0,0333 | -3       | 2        | 0,0234  | 0,1343  | 0,2278  |
| 20Y                 | 0,0573  | -3       | 4        | 0,0895  | 0,1523  | 0,2022  |
| 30Y                 | 0,0502  | -3       | 6        | 0,0625  | 0,0858  | 0,1002  |

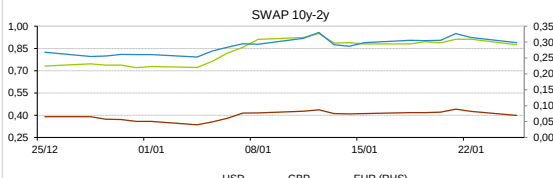
| TAXA DE REFERÊNCIA<br>BANCO CENTRAL |       |
|-------------------------------------|-------|
| Zona Euro                           | 0,00  |
| EUA                                 | 0,25  |
| Reino Unido                         | 0,10  |
| Japão                               | 0,10  |
| Canadá                              | 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                  | 0,1887 | 0        | -1       | 0,2020   | 0,6860 | 1,3410 |
| 2Y                  | 0,1973 | 0        | -1       | 0,2950   | 0,8690 | 1,4624 |
| 3Y                  | 0,2581 | -1       | 1        | 0,4357   | 1,0416 | 1,5500 |
| 4Y                  | 0,3729 | -2       | 3        | 0,5856   | 1,1728 | 1,6110 |
| 5Y                  | 0,5051 | -2       | 6        | 0,7378   | 1,2730 | 1,6738 |
| 7Y                  | 0,7745 | -3       | 11       | 0,9870   | 1,4404 | 1,7585 |
| 10Y                 | 1,0723 | -4       | 14       | 1,2330   | 1,5900 | 1,8199 |
| 15Y                 | 1,3505 | -4       | 15       | 1,4695   | 1,6810 | 1,8260 |
| 20Y                 | 1,4763 | -5       | 15       | 1,5642   | 1,7341 | 1,8453 |
| 30Y                 | 1,5595 | -5       | 15       | 1,5960   | 1,7030 | 1,7630 |

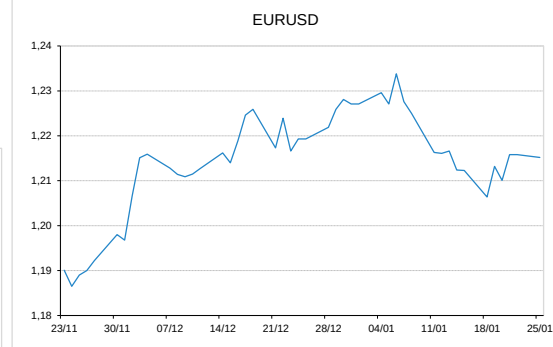
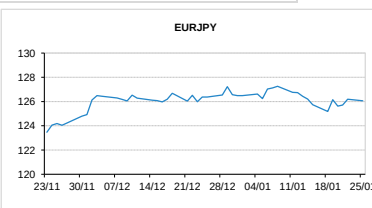
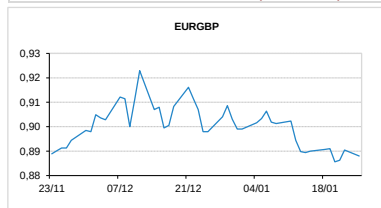


| COMMODITIES | LAST     | Var. 1D | Var. 1M | BONDS      | YIELD  | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT       | 55,43    | 0,02    | 4,09    | OT 2Y      | -0,657 | -0,02    | 7,60     |
| JETFUEL     | 462,00   | -9,00   | 29,75   | OT 5Y      | -0,438 | -0,03    | -0,60    |
| DIESEL      | 449,75   | -6,75   | 32,25   | OT 10Y     | 0,022  | -0,05    | -3,80    |
| COBRE       | 7.986,00 | -24,00  | 251,00  | BUND 10Y   | -1,255 | -4,37    | -5,00    |
| ZINCO       | 2.700,75 | 6,50    | -65,50  | SCHATZ 2Y  | -0,144 | -2,06    | -3,00    |
| OURO        | 1.855,30 | -0,32   | -24,43  | T-NOTE 10Y | 1,884  | -3,00    | 4,70     |
| TRIGO       | 643,00   | 8,50    | 16,00   | T-NOTE 2Y  | 0,711  | -0,18    | -0,20    |
| LICENÇA C02 | 33,20    | -1,04   | 1,01    | GILT 10Y   | 0,450  | -4,50    | 1,30     |



### CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M  | FW 6M  | FW 12M |
|---------|--------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,2152 | -0,05%  | -0,34%  | 1,2177 | 1,2201 | 1,2255 |
| EUR/GBP | 0,888  | 0,28%   | 1,12%   | 0,8893 | 0,8907 | 0,8933 |
| EUR/JPY | 126,06 | 0,10%   | 0,25%   | 126,06 | 126,06 | 126,06 |
| EUR/CHF | 1,0782 | -0,05%  | 0,74%   | 1,0775 | 1,0768 | 1,0755 |
| EUR/BRL | 6,6355 | 0,32%   | -4,21%  | 6,6793 | 6,7307 | 6,9184 |
| EUR/PLN | 4,5420 | -0,07%  | -0,84%  | 4,5471 | 4,5533 | 4,5689 |



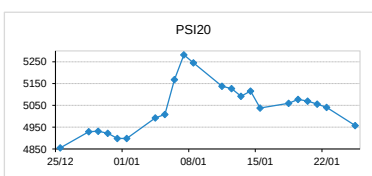
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

|     | EUR    | USD    | GBP    | JPY     | CHF    | SEK     | DKK    | CAD    | AUD     | BRL    | NOK     |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|---------|
| EUR | -      | 1,2152 | 0,8880 | 126,06  | 1,0782 | 10,0846 | 7,4392 | 1,5481 | 1,57669 | 6,6355 | 10,3916 |
| USD | 0,8245 | -      | 0,7314 | 103,775 | 0,8888 | 8,3037  | 6,1342 | 1,2746 | 1,2976  | 5,4671 | 8,5733  |

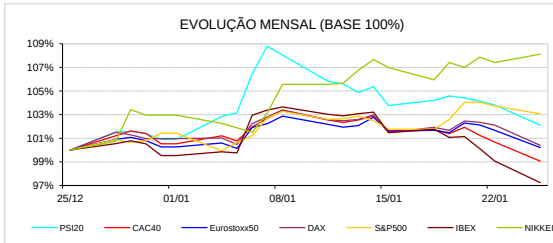
### ACCIONISTA

| TÍTULO       | COTACÃO | 1D %  | YTD % |
|--------------|---------|-------|-------|
| ALTRI        | 5,085   | -2,96 | -1,45 |
| BCP          | 0,116   | -3,25 | -5,84 |
| CORT. AMORIM | 10,920  | -1,80 | -5,86 |
| CTT          | 2,415   | -2,42 | 2,77  |
| EDP          | 5,306   | -0,04 | 2,91  |
| EDP R        | 24,400  | -2,01 | 7,02  |
| GALP         | 8,582   | -2,48 | -1,96 |
| IBERSOL      | 4,920   | -0,81 | -8,89 |
| J MARTINS    | 14,225  | -1,22 | 2,93  |
| MOTA ENGIL   | 1,386   | -1,70 | 1,61  |
| NAVIGATOR    | 2,490   | -1,43 | -0,32 |
| NOVABASE     | 3,360   | 0,60  | 4,67  |
| NOS          | 2,946   | -1,01 | 3,08  |
| PHAROL       | 0,131   | -2,96 | 4,97  |
| REN          | 2,355   | 0,43  | -0,42 |
| SEMAPA       | 8,680   | -2,03 | -3,56 |
| SONAE SGPS   | 0,680   | -3,82 | 2,80  |

| MAIORES GANHOS/PERDAS |            |
|-----------------------|------------|
| Título                | Variação % |
| NOVABASE              | 0,60       |
| REN                   | 0,43       |
| GALP                  | -2,48      |
| ALTRI                 | -2,96      |
| PHAROL                | -2,96      |
| BCP                   | -3,25      |
| SONAE SGPS            | -3,82      |



| ÍNDICE     | LAST      | Var. 1D | YTD%   | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|--------|-----------|-----------|
| PSI 20     | 4.957,27  | -1,65%  | 1,20%  | 5.454,21  | 3.500,02  |
| CAC40      | 5.470,00  | -1,61%  | -1,47% | 6.111,41  | 3.632,06  |
| ESTX 50 PR | 3.550,86  | -1,43%  | -0,05% | 3.867,28  | 2.302,84  |
| XTRA DAX   | 13.641,02 | -1,68%  | -0,57% | 14.131,52 | 8.255,65  |
| S&P 500    | 3.817,65  | -0,65%  | 1,61%  | 3.861,45  | 2.191,86  |
| IBEX 35    | 7.887,60  | -1,85%  | -2,31% | 10.100,20 | 5.814,50  |
| NIKKEI 225 | 28.822,29 | 0,67%   | 5,02%  | 28.979,53 | 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.