

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

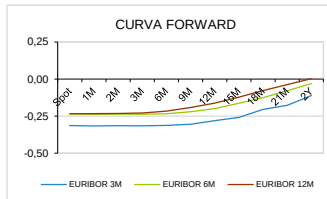
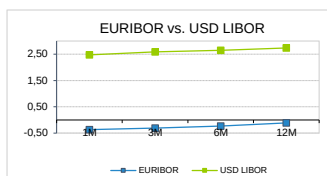
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

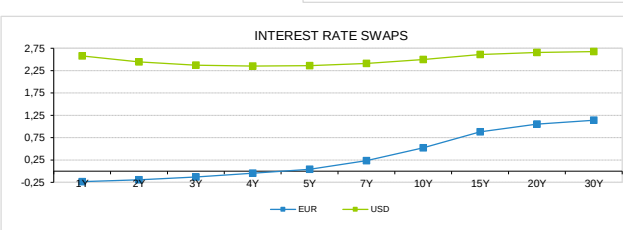
| INTERBANK OFFERED RATES |         |          |          |           |            |          |          |           |           |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M                      | -0,3670 | 0        | 0        | 1M        | 2,4735     | 0        | -1       | 0,7318    | -0,7890   |
| 3M                      | -0,3100 | 0        | 0        | 3M        | 2,5886     | -1       | -2       | 0,8294    | -0,7146   |
| 6M                      | -0,2310 | 0        | 0        | 6M        | 2,6459     | -1       | -4       | 0,9503    | -0,6492   |
| 12M                     | -0,1120 | 0        | 0        | 12M       | 2,7365     | -1       | -15      | 1,0714    | -0,4984   |

| INTEREST RATE SWAPS |         |          |          |         |        |        |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|--------|--------|
| EUR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y      | 3Y     | 5Y     |
| 1Y                  | -0,2342 | 0        | -2       | -0,1630 | 0,1991 | 0,6160 |
| 2Y                  | -0,1950 | 0        | -6       | -0,0794 | 0,3035 | 0,7230 |
| 3Y                  | -0,1290 | 0        | -9       | 0,0131  | 0,4080 | 0,8310 |
| 4Y                  | -0,0470 | 0        | -11      | 0,1113  | 0,5130 | 0,9320 |
| 5Y                  | 0,0420  | 0        | -13      | 0,2117  | 0,6190 | 1,0192 |
| 7Y                  | 0,2350  | 1        | -16      | 0,4180  | 0,8162 | 1,1640 |
| 10Y                 | 0,5240  | 1        | -18      | 0,6970  | 1,0282 | 1,3050 |
| 15Y                 | 0,8790  | 1        | -18      | 0,9848  | 1,2119 | 1,3980 |
| 20Y                 | 1,0530  | 2        | -18      | 1,1192  | 1,2769 | 1,4005 |
| 30Y                 | 1,1390  | 2        | -16      | 1,1657  | 1,2628 | 1,3326 |

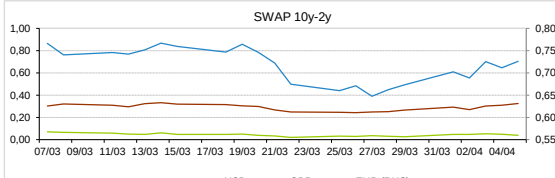
| TAXA DE REFERÊNCIA |       |
|--------------------|-------|
| BANCO CENTRAL      |       |
| Zona Euro          | 0,00  |
| EUA                | 2,50  |
| Reino Unido        | 0,75  |
| Japão              | 0,10  |
| Canadá             | 1,75  |
| Suíça              | -0,75 |
| China              | 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 | 3        | -10      | 2,3153   | 2,2480 | 2,4465 |
| 2Y                  | 2,4440 | 2        | -19      | 2,2480   | 2,2980 | 2,4890 |
| 3Y                  | 2,3710 | 2        | -22      | 2,2500   | 2,3365 | 2,5400 |
| 4Y                  | 2,3510 | 3        | -23      | 2,2620   | 2,3850 | 2,5790 |
| 5Y                  | 2,3600 | 3        | -23      | 2,2965   | 2,4325 | 2,6394 |
| 7Y                  | 2,4100 | 3        | -23      | 2,3730   | 2,5110 | 2,6760 |
| 10Y                 | 2,4990 | 3        | -25      | 2,4895   | 2,6015 | 2,7230 |
| 15Y                 | 2,6090 | 3        | -25      | 2,5855   | 2,6655 | 2,7410 |
| 20Y                 | 2,6570 | 3        | -24      | 2,6265   | 2,6850 | 2,7355 |
| 30Y                 | 2,6750 | 4        | -23      | 2,6410   | 2,7065 | 2,7160 |

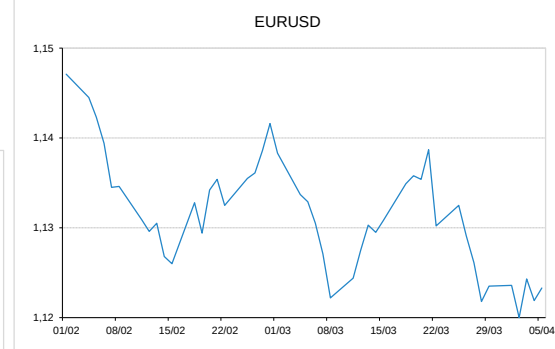
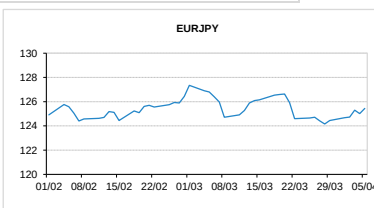
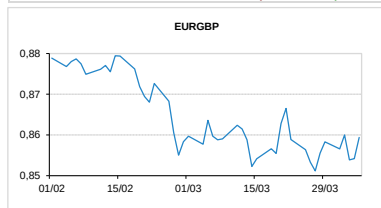


| COMMODITIES | LAST     | Var. 1D | Var. 1M | BONDS      | YIELD  | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT       | 69,94    | 0,54    | 4,02    | OT 2Y      | -0,318 | -0,01    | -6,30    |
| JETFUEL     | 653,51   | 4,07    | 1,91    | OT 5Y      | 0,174  | 0,00     | -8,80    |
| DIESEL      | 619,76   | 4,07    | -3,59   | OT 10Y     | 1,255  | -0,01    | -16,70   |
| COBRE       | 6.450,00 | -41,00  | 42,00   | BUND 10Y   | -0,393 | 1,37     | -13,00   |
| ZINCO       | 2.952,00 | -29,50  | 185,50  | SCHATZ 2Y  | 0,041  | 0,92     | -5,50    |
| OURO        | 1.292,09 | 3,08    | 8,99    | T-NOTE 10Y | 3,223  | -0,32    | -14,80   |
| TRIGO       | 468,25   | -2,50   | 5,50    | T-NOTE 2Y  | 2,696  | 0,78     | -16,80   |
| LICENÇA C02 | 24,68    | 0,24    | 1,74    | GILT 10Y   | 1,043  | 3,11     | -12,40   |



### CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING  | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M  | FW 6M  | FW 12M |
|---------|---------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,1233  | 0,12%   | -0,85%  | 1,1320 | 1,1406 | 1,1577 |
| EUR/GBP | 0,85938 | -0,61%  | 0,49%   | 0,8621 | 0,8649 | 0,8708 |
| EUR/JPY | 125,44  | -0,34%  | 1,08%   | 125,44 | 125,44 | 125,44 |
| EUR/CHF | 1,1221  | -0,03%  | 1,20%   | 1,1211 | 1,1200 | 1,1178 |
| EUR/BRL | 4,3337  | -0,06%  | -0,90%  | 4,3986 | 4,4685 | 4,6008 |
| EUR/PLN | 4,2939  | -0,11%  | 0,16%   | 4,3154 | 4,3372 | 4,3812 |



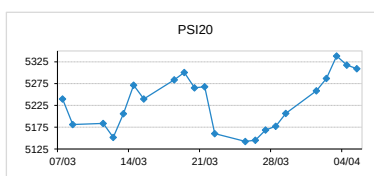
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

|     | EUR    | USD    | GBP    | JPY     | CHF    | SEK     | DKK    | CAD    | AUD     | BRL    | NOK    |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|
| EUR | -      | 1,1233 | 0,8594 | 125,44  | 1,1221 | 10,4195 | 7,4654 | 1,5018 | 1,58025 | 4,3337 | 9,6622 |
| USD | 0,8909 | -      | 0,7685 | 111,725 | 1,0002 | 9,2873  | 6,6512 | 1,3372 | 1,4078  | 3,8617 | 8,6127 |

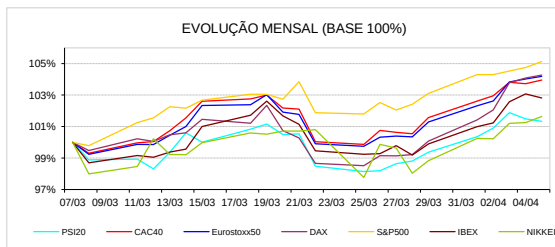
### ACCIONISTA

| TÍTULO       | COTACÃO | 1D %  | YTD %  |
|--------------|---------|-------|--------|
| ALTRI        | 7,245   | 0,98  | 24,91  |
| BCP          | 0,242   | 0,71  | 5,27   |
| CORT. AMORIM | 10,380  | -0,38 | 15,33  |
| CTT          | 2,608   | -0,23 | -11,47 |
| EDP          | 3,508   | -0,62 | 15,05  |
| EDP R        | 8,490   | -0,12 | 9,20   |
| GALP         | 14,150  | -0,49 | 2,57   |
| IBERSOL      | 7,960   | 0,51  | 0,76   |
| J MARTINS    | 13,650  | 0,81  | 32,01  |
| MOTA ENGIL   | 2,278   | -1,73 | 41,49  |
| NAVIGATOR    | 4,160   | -0,48 | 15,56  |
| NOS          | 5,980   | -0,50 | 12,94  |
| NOVABASE     | 2,480   | -0,40 | 22,77  |
| PHAROL       | 0,186   | -2,00 | 13,97  |
| REN          | 2,545   | -0,39 | 4,56   |
| SEMAPA       | 14,540  | -0,27 | 10,99  |
| SONAE CAP.   | 0,878   | 0,11  | 3,42   |
| SONAE SGPS   | 0,936   | -1,16 | 15,56  |

| MAIORES GANHOS/PERDAS |            |
|-----------------------|------------|
| Título                | Variação % |
| ALTRI                 | 0,98       |
| J MARTINS             | 0,81       |
| BCP                   | 0,71       |
| IBERSOL               | 0,51       |
| SONAE CAP.            | 0,11       |
| NOS                   | -0,50      |
| EDP                   | -0,62      |
| SONAE SGPS            | -1,16      |
| MOTA ENGIL            | -1,73      |
| PHAROL                | -2,00      |



| ÍNDICE     | LAST      | Var. 1D | YTD%   | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|--------|-----------|-----------|
| PSI 20     | 5.309,40  | -0,16%  | 12,21% | 5.801,45  | 4.551,84  |
| CAC40      | 5.476,20  | 0,23%   | 15,76% | 5.657,44  | 4.555,99  |
| ESTX 50 PR | 3.447,47  | 0,16%   | 14,86% | 3.596,20  | 2.908,70  |
| XTRA DAX   | 12.009,75 | 0,18%   | 13,74% | 13.204,31 | 10.279,20 |
| S&P 500    | 2.889,82  | 0,36%   | 15,28% | 2.940,91  | 2.346,58  |
| IBEX 35    | 9.510,30  | -0,25%  | 11,36% | 10.291,40 | 8.286,20  |
| NIKKEI 225 | 21.807,50 | 0,38%   | 8,96%  | 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.