

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

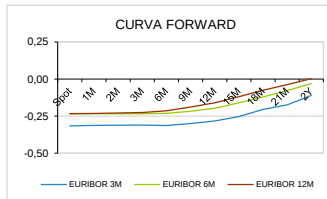
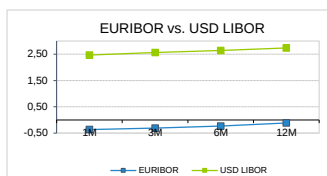
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

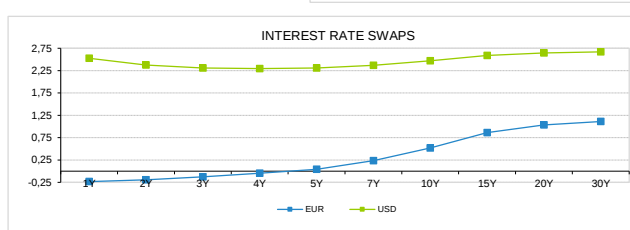
| INTERBANK OFFERED RATES |         |          |          |           |            |          |          |           |           |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M                      | -0,3650 | 0        | 0        | 1M        | 2,4671     | -2       | -1       | 0,7326    | -0,7980   |
| 3M                      | -0,3090 | 0        | 0        | 3M        | 2,5651     | -1       | -4       | 0,8138    | -0,7182   |
| 6M                      | -0,2300 | 0        | 0        | 6M        | 2,6385     | 3        | -1       | 0,9349    | -0,6562   |
| 12M                     | -0,1140 | 0        | 0        | 12M       | 2,7369     | 3        | 0        | 1,0933    | -0,5142   |

| INTEREST RATE SWAPS |         |          |          |         |        |        |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|--------|--------|
| EUR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y      | 3Y     | 5Y     |
| 1Y                  | -0,2331 | 0        | 0        | -0,1607 | 0,1993 | 0,6150 |
| 2Y                  | -0,1920 | 0        | 1        | -0,0785 | 0,3058 | 0,7260 |
| 3Y                  | -0,1270 | -1       | 1        | 0,0124  | 0,4070 | 0,8330 |
| 4Y                  | -0,0460 | 0        | 2        | 0,1118  | 0,5140 | 0,9300 |
| 5Y                  | 0,0410  | -1       | 2        | 0,2117  | 0,6200 | 1,0180 |
| 7Y                  | 0,2340  | 0        | 3        | 0,4186  | 0,8110 | 1,1610 |
| 10Y                 | 0,5200  | 0        | 3        | 0,6940  | 1,0268 | 1,3060 |
| 15Y                 | 0,8640  | -1       | 3        | 0,9875  | 1,2171 | 1,4040 |
| 20Y                 | 1,0350  | -1       | 3        | 1,1257  | 1,2843 | 1,4020 |
| 30Y                 | 1,1110  | -1       | 2        | 1,1691  | 1,2649 | 1,3320 |

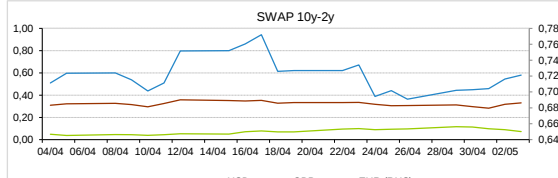
| TAXA DE REFERÊNCIA |       |
|--------------------|-------|
| BANCO CENTRAL      |       |
| Zona Euro          | 0,00  |
| EUA                | 2,50  |
| Reino Unido        | 0,75  |
| Japão              | 0,10  |
| Canadá             | 1,75  |
| Suíça              | -0,75 |
| China              | 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                  | 2,5250 | 0        | -3       | 2,3308   | 2,3070 | 2,4900 |
| 2Y                  | 2,3740 | -1       | -6       | 2,2934   | 2,3480 | 2,5245 |
| 3Y                  | 2,3090 | -1       | -6       | 2,2810   | 2,3950 | 2,5690 |
| 4Y                  | 2,2950 | -2       | -5       | 2,3100   | 2,4215 | 2,6200 |
| 5Y                  | 2,3090 | -2       | -4       | 2,3440   | 2,4690 | 2,6783 |
| 7Y                  | 2,3680 | -2       | -3       | 2,4025   | 2,5470 | 2,7090 |
| 10Y                 | 2,4690 | -3       | -1       | 2,5260   | 2,6310 | 2,7395 |
| 15Y                 | 2,5900 | -3       | 0        | 2,6130   | 2,7095 | 2,7655 |
| 20Y                 | 2,6450 | -3       | 1        | 2,6545   | 2,7135 | 2,7760 |
| 30Y                 | 2,6690 | -4       | 2        | 2,7013   | 2,7005 | 2,7330 |

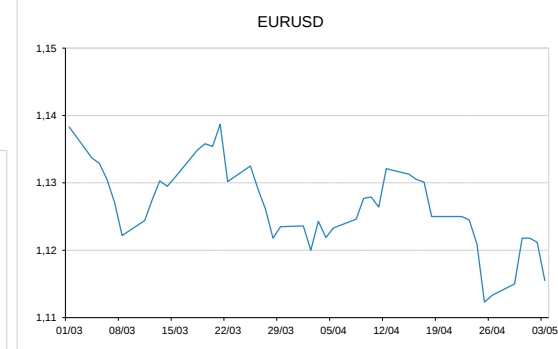
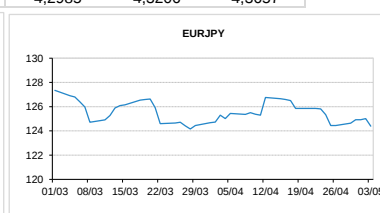


| COMMODITIES | LAST     | Var. 1D | Var. 1M | BONDS      | YIELD  | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT       | 71,32    | 0,57    | 2,41    | OT 2Y      | -0,334 | 0,00     | -2,00    |
| JETFUEL     | 676,53   | 10,45   | 27,09   | OT 5Y      | 0,082  | 0,00     | -9,20    |
| DIESEL      | 649,53   | 10,45   | 33,84   | OT 10Y     | 1,121  | 0,01     | -15,00   |
| COBRE       | 6.175,00 | -68,00  | -259,50 | BUND 10Y   | -0,383 | 0,29     | 1,50     |
| ZINCO       | 2.806,00 | -41,00  | -85,00  | SCHATZ 2Y  | 0,032  | -0,23    | 0,20     |
| OURO        | 1.279,43 | 9,02    | -11,50  | T-NOTE 10Y | 3,251  | -1,46    | 2,00     |
| TRIGO       | 436,00   | -8,00   | -38,50  | T-NOTE 2Y  | 2,716  | -0,58    | 3,90     |
| LICENÇA C02 | 25,20    | 0,50    | 2,04    | GILT 10Y   | 1,146  | 3,51     | 14,50    |



### CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING  | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M  | FW 6M  | FW 12M |
|---------|---------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,1155  | -0,51%  | -0,78%  | 1,1243 | 1,1329 | 1,1499 |
| EUR/GBP | 0,85785 | 0,17%   | -0,46%  | 0,8605 | 0,8633 | 0,8695 |
| EUR/JPY | 124,4   | 0,49%   | 0,72%   | 124,40 | 124,40 | 124,40 |
| EUR/CHF | 1,1386  | 0,04%   | -1,52%  | 1,1375 | 1,1363 | 1,1342 |
| EUR/BRL | 4,4045  | 0,65%   | -1,25%  | 4,4741 | 4,5442 | 4,6770 |
| EUR/PLN | 4,2765  | 0,23%   | 0,32%   | 4,2985 | 4,3206 | 4,3657 |



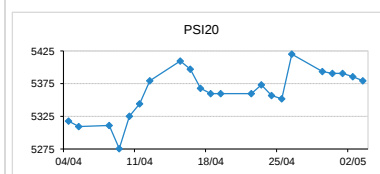
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

|     | EUR    | USD    | GBP    | JPY     | CHF    | SEK     | DKK    | CAD    | AUD     | BRL    | NOK    |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|
| EUR | -      | 1,1155 | 0,8579 | 124,40  | 1,1386 | 10,6837 | 7,4658 | 1,5019 | 1,59408 | 4,4045 | 9,7416 |
| USD | 0,8939 | -      | 0,7623 | 111,235 | 1,0177 | 9,5497  | 6,6741 | 1,3422 | 1,4248  | 3,9371 | 8,7119 |

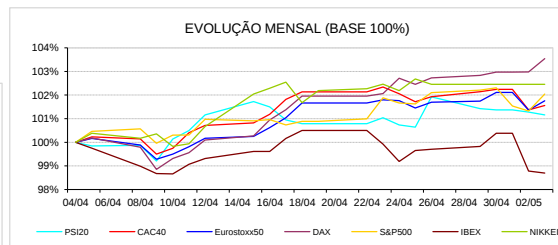
### ACCIONISTA

| TÍTULO       | COTACÃO | 1D %  | YTD %  |
|--------------|---------|-------|--------|
| ALTRI        | 6,960   | 0,14  | 20,00  |
| BCP          | 0,256   | 0,75  | 11,72  |
| CORT. AMORIM | 10,720  | 0,75  | 19,11  |
| CTT          | 2,542   | 1,11  | -13,71 |
| EDP          | 3,328   | -0,63 | 9,15   |
| EDP R        | 8,790   | 0,11  | 13,05  |
| GALP         | 14,950  | 0,10  | 8,37   |
| IBERSOL      | 7,980   | 0,25  | 1,01   |
| J MARTINS    | 14,575  | 0,24  | 40,96  |
| MOTA ENGIL   | 2,312   | -1,37 | 43,60  |
| NAVIGATOR    | 3,836   | -1,94 | 6,56   |
| NOS          | 5,955   | 0,00  | 12,46  |
| NOVABASE     | 2,490   | 0,40  | 23,27  |
| PHAROL       | 0,162   | -0,37 | -0,98  |
| RAMADA       | 7,700   | 0,00  | 2,67   |
| REN          | 14,480  | -0,55 | 10,53  |
| SEMAPA       | 0,910   | 0,22  | 7,18   |
| SONAE CAP.   | 0,990   | -0,95 | 22,22  |
| SONAE SGPS   | 7,700   | 0,00  | 2,67   |

| MAIORES GANHOS/PERDAS |            |
|-----------------------|------------|
| Título                | Variação % |
| CTT                   | 1,11       |
| CORT. AMORIM          | 0,75       |
| BCP                   | 0,75       |
| NOVABASE              | 0,40       |
| IBERSOL               | 0,25       |
| REN                   | -0,55      |
| EDP                   | -0,63      |
| SONAE CAP.            | -0,95      |
| MOTA ENGIL            | -1,37      |
| NAVIGATOR             | -1,94      |



| ÍNDICE     | LAST      | Var. 1D | YTD%   | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|--------|-----------|-----------|
| PSI 20     | 5.379,50  | -0,12%  | 13,70% | 5.801,45  | 4.551,84  |
| CAC40      | 5.548,84  | 0,18%   | 17,29% | 5.657,44  | 4.555,99  |
| ESTX 50 PR | 3.502,48  | 0,39%   | 16,69% | 3.596,20  | 2.908,70  |
| XTRA DAX   | 12.412,75 | 0,55%   | 17,56% | 13.204,31 | 10.279,20 |
| S&P 500    | 2.938,16  | 0,71%   | 17,20% | 2.954,13  | 2.346,58  |
| IBEX 35    | 9.409,60  | -0,09%  | 10,18% | 10.291,40 | 8.286,20  |
| NIKKEI 225 | 22.258,73 | -0,22%  | 11,21% | 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.