

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

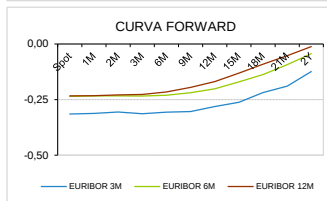
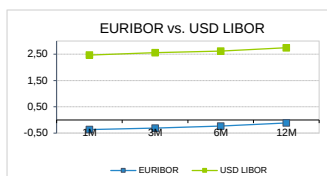
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

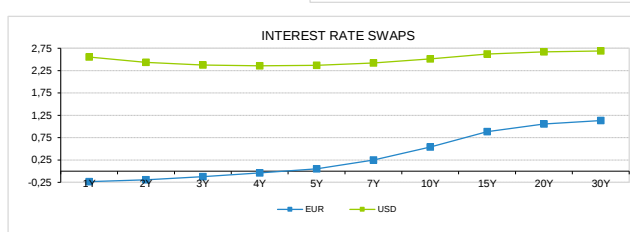
| INTERBANK OFFERED RATES |         |          |          |           |            |          |          |           |           |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M                      | -0,3650 | 0        | 0        | 1M        | 2,4666     | 0        | -1       | 0,7314    | -0,7940   |
| 3M                      | -0,3080 | 0        | 0        | 3M        | 2,5599     | -1       | -4       | 0,8124    | -0,7178   |
| 6M                      | -0,2300 | 0        | 0        | 6M        | 2,6174     | -2       | -4       | 0,9244    | -0,6528   |
| 12M                     | -0,1140 | 0        | 0        | 12M       | 2,7455     | 1        | 0        | 1,0828    | -0,5152   |

| INTEREST RATE SWAPS |         |          |          |         |        |        |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|--------|--------|
| EUR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y      | 3Y     | 5Y     |
| 1Y                  | -0,2338 | 0        | 0        | -0,1705 | 0,1877 | 0,5878 |
| 2Y                  | -0,1920 | 0        | 0        | -0,0914 | 0,2885 | 0,7070 |
| 3Y                  | -0,1220 | 1        | 1        | 0,0015  | 0,3880 | 0,8135 |
| 4Y                  | -0,0390 | 1        | 1        | 0,0981  | 0,4974 | 0,9048 |
| 5Y                  | 0,0520  | 1        | 1        | 0,1952  | 0,6017 | 0,9989 |
| 7Y                  | 0,2490  | 2        | 2        | 0,4018  | 0,7922 | 1,1424 |
| 10Y                 | 0,5390  | 2        | 2        | 0,6752  | 1,0037 | 1,2880 |
| 15Y                 | 0,8830  | 2        | 2        | 0,9667  | 1,1953 | 1,3896 |
| 20Y                 | 1,0550  | 2        | 2        | 1,1064  | 1,2638 | 1,3881 |
| 30Y                 | 1,1320  | 2        | 1        | 1,1532  | 1,2501 | 1,3203 |

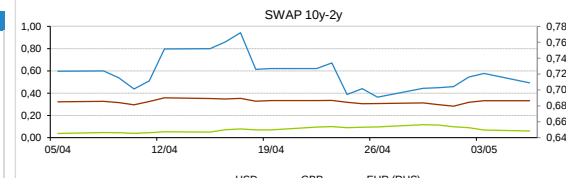
| TAXA DE REFERÊNCIA |       |
|--------------------|-------|
| BANCO CENTRAL      |       |
| Zona Euro          | 0,00  |
| EUA                | 2,50  |
| Reino Unido        | 0,75  |
| Japão              | 0,10  |
| Canadá             | 1,75  |
| Suíça              | -0,75 |
| China              | 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                  | 2,5550 | -1       | -2       | 2,2696   | 2,2518 | 2,2953 |
| 2Y                  | 2,4340 | -1       | -1       | 2,2120   | 2,3066 | 2,5060 |
| 3Y                  | 2,3730 | -1       | 0        | 2,2284   | 2,4767 | 2,7051 |
| 4Y                  | 2,3570 | -2       | 1        | 2,2725   | 2,3820 | 2,7090 |
| 5Y                  | 2,3660 | -2       | 1        | 2,3116   | 2,4280 | 2,6236 |
| 7Y                  | 2,4190 | -2       | 1        | 2,3831   | 2,5275 | 2,7634 |
| 10Y                 | 2,5110 | -2       | 1        | 2,4908   | 2,6143 | 2,7080 |
| 15Y                 | 2,6210 | -2       | 1        | 2,5949   | 2,6806 | 2,7340 |
| 20Y                 | 2,6700 | -3       | 1        | 2,6398   | 2,7009 | 2,7558 |
| 30Y                 | 2,6890 | -3       | 1        | 2,6547   | 2,6710 | 2,7020 |

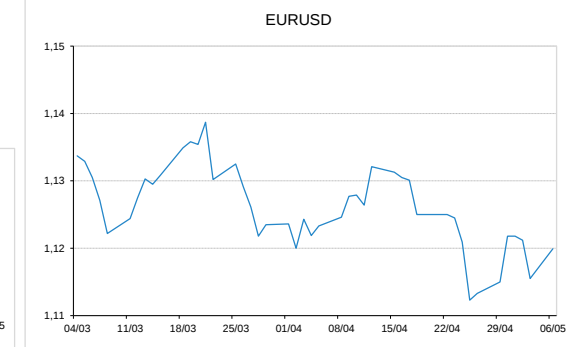
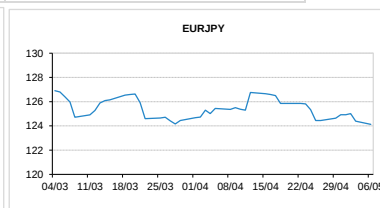
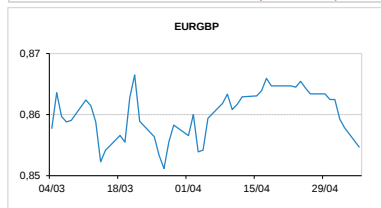


| COMMODITIES | LAST     | Var. 1D | Var. 1M | BONDS      | YIELD  | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT       | 70,83    | -0,02   | 0,90    | OT 2Y      | -0,337 | 0,00     | -2,60    |
| JETFUEL     | 676,53   | 10,45   | 27,09   | OT 5Y      | 0,086  | 0,00     | -9,10    |
| DIESEL      | 649,53   | 10,45   | 33,84   | OT 10Y     | 1,123  | 0,00     | -13,90   |
| COBRE       | 6.243,00 | 69,00   | -256,00 | BUND 10Y   | -0,403 | -1,45    | 0,40     |
| ZINCO       | 2.853,00 | 47,00   | -109,50 | SCHATZ 2Y  | 0,030  | -0,23    | -0,20    |
| OURO        | 1.280,24 | -0,83   | -11,47  | T-NOTE 10Y | 3,207  | -4,05    | -1,90    |
| TRIGO       | 436,75   | -1,25   | -33,00  | T-NOTE 2Y  | 2,679  | -3,69    | -0,90    |
| LICENÇA C02 | 25,42    | 0,22    | 0,82    | GILT 10Y   | 1,142  | 0,00     | 13,00    |



### CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M  | FW 6M  | FW 12M |
|---------|--------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,1199 | 0,39%   | -0,42%  | 1,1287 | 1,1372 | 1,1541 |
| EUR/GBP | 0,8547 | 0,37%   | 0,83%   | 0,8573 | 0,8601 | 0,8663 |
| EUR/JPY | 124,13 | 0,22%   | 0,99%   | 124,13 | 124,13 | 124,13 |
| EUR/CHF | 1,1397 | -0,08%  | -1,25%  | 1,1386 | 1,1375 | 1,1353 |
| EUR/BRL | 4,4273 | -0,33%  | -2,01%  | 4,4971 | 4,5682 | 4,7021 |
| EUR/PLN | 4,2831 | -0,16%  | 0,13%   | 4,3049 | 4,3268 | 4,3713 |



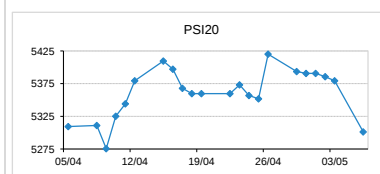
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

|     | EUR    | USD    | GBP    | JPY    | CHF    | SEK     | DKK    | CAD    | AUD     | BRL    | NOK    |
|-----|--------|--------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|
| EUR | -      | 1,1199 | 0,8547 | 124,13 | 1,1397 | 10,7076 | 7,4663 | 1,5059 | 1,60069 | 4,4273 | 9,7754 |
| USD | 0,8934 | -      | 0,7638 | 110,89 | 1,0184 | 9,5650  | 6,6704 | 1,3457 | 1,4297  | 3,9595 | 8,7318 |

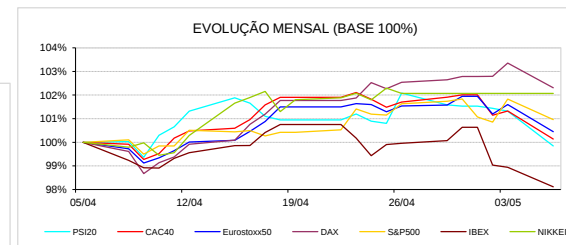
### ACCIONISTA

| TÍTULO       | COTACÃO | 1D %  | YTD %  |
|--------------|---------|-------|--------|
| ALTRI        | 6,880   | -1,15 | 18,62  |
| BCP          | 0,250   | -2,50 | 8,93   |
| CORT. AMORIM | 10,500  | -2,05 | 16,67  |
| CTT          | 2,504   | -1,49 | -15,00 |
| EDP          | 3,319   | -0,27 | 8,86   |
| EDP R        | 8,670   | -1,37 | 11,51  |
| GALP         | 14,710  | -1,61 | 6,63   |
| IBERSOL      | 7,800   | -2,26 | -1,27  |
| J MARTINS    | 14,280  | -2,02 | 38,10  |
| MOTA ENGIL   | 2,252   | -2,60 | 39,88  |
| NAVIGATOR    | 3,766   | -1,82 | 4,61   |
| NOS          | 5,875   | -1,34 | 10,95  |
| NOVABASE     | 2,520   | 1,20  | 24,75  |
| PHAROL       | 0,159   | -1,61 | -2,57  |
| RAMADA       | 7,720   | 0,26  | 2,93   |
| REN          | 14,380  | -0,69 | 9,77   |
| SEMAPA       | 0,894   | -1,76 | 5,30   |
| SONAE CAP.   | 0,978   | -1,21 | 20,74  |
| SONAE SGPS   | 7,720   | 0,26  | 2,93   |

| MAIORES GANHOS/PERDAS |            |
|-----------------------|------------|
| Título                | Variação % |
| NOVABASE              | 1,20       |
| RAMADA                | 0,26       |
| RAMADA                | 0,26       |
| J MARTINS             | -2,02      |
| CORT. AMORIM          | -2,05      |
| IBERSOL               | -2,26      |
| BCP                   | -2,50      |
| MOTA ENGIL            | -2,60      |



| ÍNDICE     | LAST      | Var. 1D | YTD%   | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|--------|-----------|-----------|
| PSI 20     | 5.301,30  | -1,45%  | 12,04% | 5.801,45  | 4.551,84  |
| CAC40      | 5.483,52  | -1,18%  | 15,91% | 5.657,44  | 4.555,99  |
| ESTX 50 PR | 3.462,95  | -1,13%  | 15,38% | 3.596,20  | 2.908,70  |
| XTRA DAX   | 12.286,88 | -1,01%  | 16,36% | 13.204,31 | 10.279,20 |
| S&P 500    | 2.920,85  | -0,85%  | 16,50% | 2.954,13  | 2.346,58  |
| IBEX 35    | 9.331,00  | -0,84%  | 9,26%  | 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.