

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

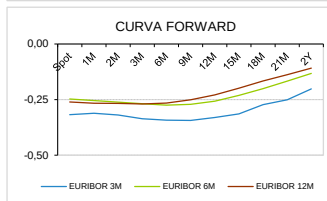
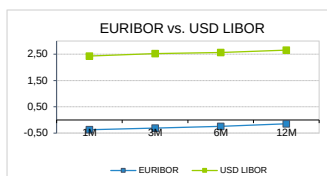
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

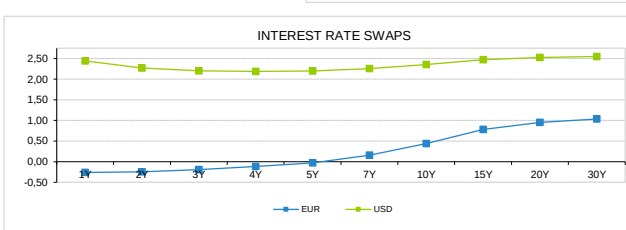
| INTERBANK OFFERED RATES |         |          |          |           |            |          |          |           |           |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M                      | -0,3710 | 0        | 0        | 1M        | 2,4296     | -1       | -5       | 0,7305    | -0,7934   |
| 3M                      | -0,3110 | 0        | 0        | 3M        | 2,5235     | 0        | -6       | 0,8033    | -0,7118   |
| 6M                      | -0,2420 | 0        | -1       | 6M        | 2,5633     | 0        | -7       | 0,9031    | -0,6544   |
| 12M                     | -0,1450 | 0        | -3       | 12M       | 2,6536     | 1        | -9       | 1,0469    | -0,5188   |

| INTEREST RATE SWAPS |         |          |          |         |        |        |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|--------|--------|
| EUR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y      | 3Y     | 5Y     |
| 1Y                  | -0,2610 | 0        | -3       | -0,2302 | 0,0715 | 0,5170 |
| 2Y                  | -0,2440 | 0        | -5       | -0,1684 | 0,1891 | 0,6200 |
| 3Y                  | -0,1920 | 0        | -6       | -0,0770 | 0,3000 | 0,7250 |
| 4Y                  | -0,1170 | 0        | -8       | 0,0160  | 0,4050 | 0,8220 |
| 5Y                  | -0,0300 | 0        | -9       | 0,1170  | 0,5100 | 0,9060 |
| 7Y                  | 0,1580  | 0        | -10      | 0,3190  | 0,7000 | 1,0607 |
| 10Y                 | 0,4390  | 1        | -10      | 0,5920  | 0,9217 | 1,2020 |
| 15Y                 | 0,7830  | 1        | -11      | 0,8903  | 1,1179 | 1,3050 |
| 20Y                 | 0,9530  | 1        | -11      | 1,0315  | 1,1894 | 1,3080 |
| 30Y                 | 1,0350  | 1        | -10      | 1,0810  | 1,1740 | 1,2420 |

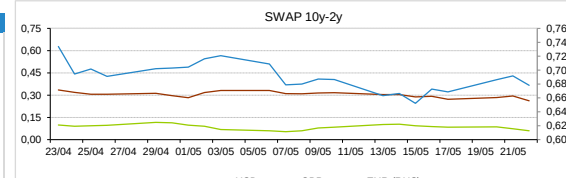
| TAXA DE REFERÊNCIA |       |
|--------------------|-------|
| BANCO CENTRAL      |       |
| Zona Euro          | 0,00  |
| EUA                | 2,50  |
| Reino Unido        | 0,75  |
| Japão              | 0,10  |
| Canadá             | 1,75  |
| Suíça              | -0,75 |
| China              | 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                  | 2,4430 | 0        | -16      | 2,1031   | 2,1267 | 2,3130 |
| 2Y                  | 2,2720 | -1       | -21      | 2,0600   | 2,1560 | 2,3839 |
| 3Y                  | 2,2040 | 0        | -21      | 2,0953   | 2,2318 | 2,4290 |
| 4Y                  | 2,1880 | 0        | -21      | 2,1283   | 2,2804 | 2,4714 |
| 5Y                  | 2,2000 | 0        | -21      | 2,1685   | 2,3258 | 2,5096 |
| 7Y                  | 2,2560 | 0        | -20      | 2,2514   | 2,4091 | 2,5690 |
| 10Y                 | 2,3550 | -1       | -20      | 2,3654   | 2,4991 | 2,5960 |
| 15Y                 | 2,4740 | -1       | -19      | 2,4555   | 2,5460 | 2,6230 |
| 20Y                 | 2,5270 | -1       | -19      | 2,5010   | 2,5650 | 2,6170 |
| 30Y                 | 2,5490 | -1       | -19      | 2,5417   | 2,5842 | 2,6178 |

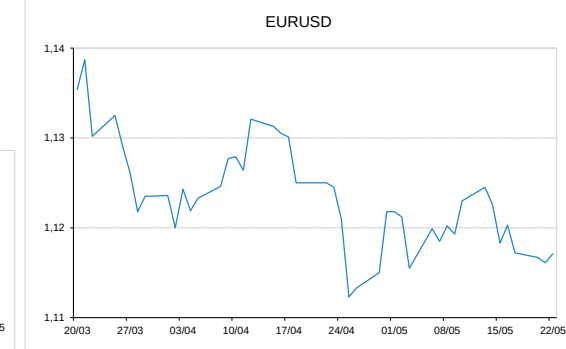
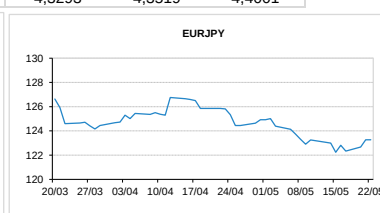


| COMMODITIES | LAST     | Var. 1D | Var. 1M | BONDS      | YIELD  | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT       | 70,74    | -1,44   | -2,65   | OT 2Y      | -0,384 | -0,01    | -3,00    |
| JETFUEL     | 667,50   | -10,50  | -1,00   | OT 5Y      | 0,048  | 0,00     | -8,30    |
| DIESEL      | 638,00   | -9,00   | -0,75   | OT 10Y     | 1,026  | -0,01    | -14,80   |
| COBRE       | 6,006,00 | -33,00  | -480,00 | BUND 10Y   | -0,498 | -2,15    | -11,30   |
| ZINCO       | 2,654,50 | 6,25    | -133,50 | SCHATZ 2Y  | -0,009 | -0,69    | -5,00    |
| OURO        | 1,275,41 | 2,14    | 1,03    | T-NOTE 10Y | 3,133  | -3,22    | -15,70   |
| TRIGO       | 474,75   | -4,00   | 33,00   | T-NOTE 2Y  | 2,625  | -2,91    | -12,40   |
| LICENÇA C02 | 26,42    | 1,04    | -0,47   | GILT 10Y   | 0,929  | -8,01    | -19,40   |



### CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M  | FW 6M  | FW 12M |
|---------|--------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,1171 | 0,09%   | -0,70%  | 1,1259 | 1,1342 | 1,1508 |
| EUR/GBP | 0,8828 | -0,76%  | -2,05%  | 0,8856 | 0,8884 | 0,8945 |
| EUR/JPY | 123,27 | 0,00%   | 2,10%   | 123,27 | 123,27 | 123,27 |
| EUR/CHF | 1,1254 | 0,22%   | 1,59%   | 1,1243 | 1,1232 | 1,1211 |
| EUR/BRL | 4,497  | 0,23%   | -1,48%  | 4,5674 | 4,6351 | 4,7659 |
| EUR/PLN | 4,3063 | 0,02%   | -0,51%  | 4,3293 | 4,3519 | 4,4001 |



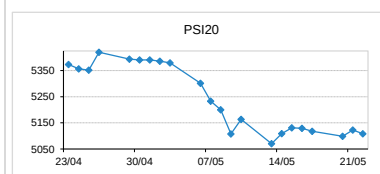
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

|     | EUR    | USD    | GBP    | JPY     | CHF    | SEK     | DKK    | CAD    | AUD     | BRL    | NOK    |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|
| EUR | -      | 1,1171 | 0,8828 | 123,27  | 1,1254 | 10,7474 | 7,4682 | 1,4968 | 1,62148 | 4,4970 | 9,7629 |
| USD | 0,8965 | -      | 0,79   | 110,315 | 1,0092 | 9,6420  | 6,6956 | 1,3406 | 1,4542  | 4,0176 | 8,7533 |

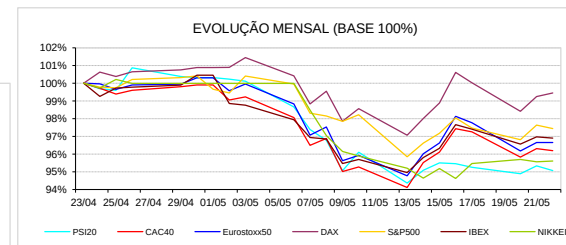
### ACCIONISTA

| TÍTULO       | COTACÃO | 1D %  | YTD %  |
|--------------|---------|-------|--------|
| ALTRI        | 6,300   | 1,94  | 8,62   |
| BCP          | 0,251   | -0,71 | 9,32   |
| CORT. AMORIM | 10,640  | 2,31  | 18,22  |
| CTT          | 2,306   | 2,95  | -21,72 |
| EDP          | 3,269   | 0,18  | 7,22   |
| EDP R        | 8,800   | 0,46  | 13,18  |
| GALP         | 14,385  | -0,10 | 4,28   |
| IBERSOL      | 8,100   | 0,00  | 2,53   |
| J MARTINS    | 13,500  | 1,35  | 30,56  |
| MOTA ENGIL   | 2,154   | -0,65 | 33,79  |
| NAVIGATOR    | 3,404   | -0,53 | -5,44  |
| NOS          | 5,595   | 1,91  | 5,67   |
| NOVABASE     | 2,400   | -1,23 | 18,81  |
| PHAROL       | 0,151   | -1,18 | -7,35  |
| RAMADA       | 7,700   | 0,00  | 2,67   |
| REN          | 13,060  | 0,62  | -0,31  |
| SEMAPA       | 0,889   | -1,02 | 4,71   |
| SONAE CAP.   | 0,897   | -0,94 | 10,68  |
| SONAE SGPS   | 7,700   | 0,00  | 2,67   |

| MAIORES GANHOS/PERDAS |            |
|-----------------------|------------|
| Título                | Variação % |
| CTT                   | 2,95       |
| CORT. AMORIM          | 2,31       |
| ALTRI                 | 1,94       |
| NOS                   | 1,91       |
| J MARTINS             | 1,35       |
| MOTA ENGIL            | -0,65      |
| BCP                   | -0,71      |
| SONAE CAP.            | -0,94      |
| PHAROL                | -1,18      |
| NOVABASE              | -1,23      |



| ÍNDICE     | LAST      | Var. 1D | YTD%   | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|--------|-----------|-----------|
| PSI 20     | 5,108,06  | -0,28%  | 7,96%  | 5,801,45  | 4,551,84  |
| CAC40      | 5,378,98  | -0,12%  | 13,70% | 5,653,09  | 4,555,99  |
| ESTX 50 PR | 3,386,72  | 0,01%   | 12,84% | 3,595,10  | 2,908,70  |
| XTRA DAX   | 12,168,74 | 0,21%   | 15,25% | 13,204,31 | 10,279,20 |
| S&P 500    | 2,857,91  | -0,20%  | 14,03% | 2,954,13  | 2,346,58  |
| IBEX 35    | 9,232,20  | -0,07%  | 8,11%  | 10,156,40 | 8,286,20  |
| NIKKEI 225 | 21,283,37 | 0,05%   | 6,34%  | 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.