

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

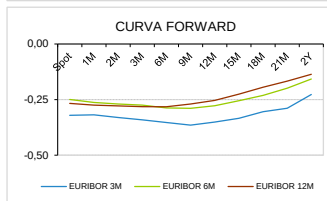
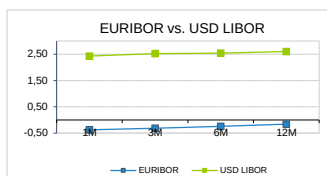
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

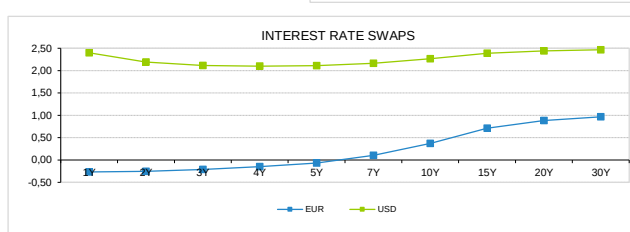
| INTERBANK OFFERED RATES |         |          |          |           |            |          |          |           |           |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M                      | -0,3740 | 0        | -1       | 1M        | 2,4294     | 0        | -5       | 0,7263    | -0,7946   |
| 3M                      | -0,3170 | 0        | -1       | 3M        | 2,5238     | 0        | -6       | 0,7945    | -0,7118   |
| 6M                      | -0,2450 | 0        | -1       | 6M        | 2,5413     | -1       | -7       | 0,8919    | -0,6610   |
| 12M                     | -0,1580 | -1       | -4       | 12M       | 2,5999     | -2       | -12      | 1,0130    | -0,5222   |

| INTEREST RATE SWAPS |         |          |          |         |         |        |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|---------|--------|
| EUR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y      | 3Y      | 5Y     |
| 1Y                  | -0,2673 | 0        | -4       | -0,2549 | -0,0230 | 0,4100 |
| 2Y                  | -0,2550 | -1       | -6       | -0,1948 | 0,1015  | 0,5119 |
| 3Y                  | -0,2120 | -1       | -8       | -0,1200 | 0,2197  | 0,6130 |
| 4Y                  | -0,1470 | -1       | -9       | -0,0343 | 0,3082  | 0,7090 |
| 5Y                  | -0,0690 | -1       | -9       | 0,0544  | 0,4100  | 0,7940 |
| 7Y                  | 0,1040  | -2       | -11      | 0,2416  | 0,5972  | 0,9406 |
| 10Y                 | 0,3710  | -2       | -12      | 0,5044  | 0,8119  | 1,0928 |
| 15Y                 | 0,7100  | -3       | -13      | 0,7954  | 1,0102  | 1,1980 |
| 20Y                 | 0,8820  | -3       | -13      | 0,9361  | 1,0850  | 1,2048 |
| 30Y                 | 0,9660  | -3       | -13      | 0,9871  | 1,0779  | 1,1420 |

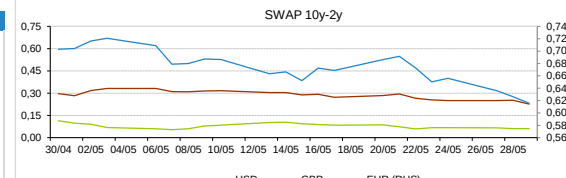
| TAXA DE REFERÊNCIA |       |
|--------------------|-------|
| BANCO CENTRAL      |       |
| Zona Euro          | 0,00  |
| EUA                | 2,50  |
| Reino Unido        | 0,75  |
| Japão              | 0,10  |
| Canadá             | 1,75  |
| Suíça              | -0,75 |
| China              | 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                  | 2,3980 | -2       | -15      | 1,8771   | 1,9419 | 2,1600 |
| 2Y                  | 2,1900 | -3       | -22      | 1,8240   | 1,9955 | 2,2068 |
| 3Y                  | 2,1150 | -3       | -24      | 1,8505   | 2,0230 | 2,2330 |
| 4Y                  | 2,0990 | -3       | -24      | 1,9210   | 2,0730 | 2,2974 |
| 5Y                  | 2,1100 | -2       | -24      | 1,9661   | 2,1210 | 2,3388 |
| 7Y                  | 2,1640 | -2       | -24      | 2,0567   | 2,2337 | 2,3735 |
| 10Y                 | 2,2640 | -2       | -24      | 2,1816   | 2,3268 | 2,4310 |
| 15Y                 | 2,3860 | -2       | -24      | 2,2984   | 2,4012 | 2,4555 |
| 20Y                 | 2,4400 | -2       | -24      | 2,3505   | 2,4245 | 2,4530 |
| 30Y                 | 2,4660 | -2       | -24      | 2,3733   | 2,4060 | 2,4390 |

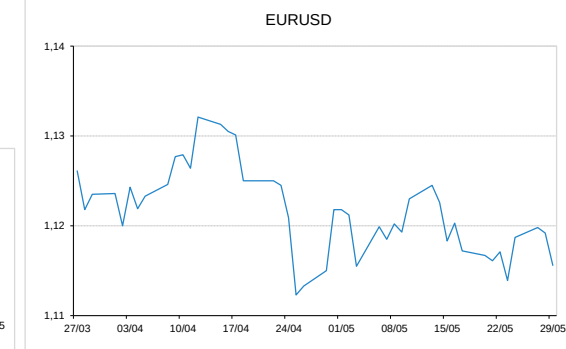
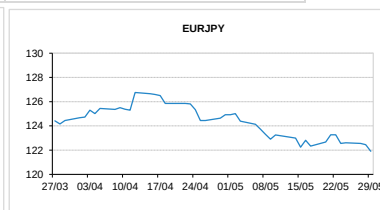
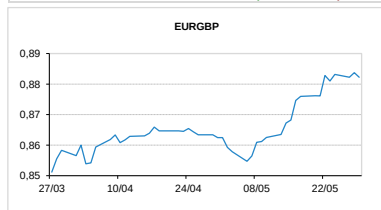


| COMMODITIES | LAST     | Var. 1D | Var. 1M | BONDS      | YIELD  | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT       | 68,50    | -1,61   | -3,04   | OT 2Y      | -0,400 | 0,00     | -5,90    |
| JETFUEL     | 638,00   | -15,66  | -25,50  | OT 5Y      | -0,035 | -0,03    | -13,00   |
| DIESEL      | 608,50   | -14,91  | -26,25  | OT 10Y     | 0,850  | -0,07    | -27,50   |
| COBRE       | 5,966,00 | 5,00    | -440,00 | BUND 10Y   | -0,591 | -2,20    | -18,30   |
| ZINCO       | 2,673,00 | 9,00    | -129,50 | SCHATZ 2Y  | -0,032 | -0,46    | -6,60    |
| OURO        | 1,283,43 | 5,55    | 4,34    | T-NOTE 10Y | 2,992  | -4,45    | -24,60   |
| TRIGO       | 499,50   | -5,25   | 64,25   | T-NOTE 2Y  | 2,485  | -5,22    | -18,00   |
| LICENÇA C02 | 25,52    | 0,04    | -0,86   | GILT 10Y   | 0,806  | -3,68    | -26,80   |



### CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING  | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M  | FW 6M  | FW 12M |
|---------|---------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,1156  | -0,32%  | 0,05%   | 1,1241 | 1,1322 | 1,1478 |
| EUR/GBP | 0,88225 | 0,17%   | -2,14%  | 0,8849 | 0,8877 | 0,8937 |
| EUR/JPY | 121,91  | 0,44%   | 2,24%   | 121,91 | 121,91 | 121,91 |
| EUR/CHF | 1,1212  | 0,49%   | 1,70%   | 1,1200 | 1,1189 | 1,1168 |
| EUR/BRL | 4,449   | 0,97%   | -0,86%  | 4,5187 | 4,5860 | 4,7089 |
| EUR/PLN | 4,2963  | 0,00%   | -0,09%  | 4,3181 | 4,3400 | 4,3867 |



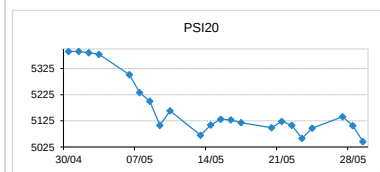
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

|     | EUR    | USD    | GBP    | JPY     | CHF    | SEK     | DKK    | CAD    | AUD     | BRL    | NOK    |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|
| EUR | -      | 1,1156 | 0,8823 | 121,91  | 1,1212 | 10,6676 | 7,4685 | 1,5061 | 1,61139 | 4,4490 | 9,7621 |
| USD | 0,8973 | -      | 0,7912 | 109,355 | 1,0075 | 9,5808  | 6,6997 | 1,3528 | 1,4469  | 3,9964 | 8,7659 |

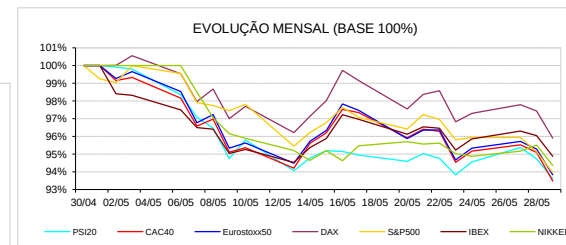
### ACCIONISTA

| TÍTULO       | COTACÃO | 1D %  | YTD %  |
|--------------|---------|-------|--------|
| ALTRI        | 5,895   | -4,61 | 1,64   |
| BCP          | 0,253   | -1,52 | 10,37  |
| CORT. AMORIM | 10,340  | -0,58 | 14,89  |
| CTT          | 2,258   | -2,50 | -23,35 |
| EDP          | 3,293   | -1,91 | 8,00   |
| EDP R        | 8,850   | 1,26  | 13,83  |
| GALP         | 13,730  | -0,94 | -0,47  |
| IBERSOL      | 8,100   | -0,74 | 2,53   |
| J MARTINS    | 13,740  | -1,08 | 32,88  |
| MOTA ENGIL   | 2,102   | -0,28 | 30,56  |
| NAVIGATOR    | 3,212   | -2,90 | -10,78 |
| NOS          | 5,475   | -0,64 | 3,40   |
| NOVABASE     | 2,400   | 0,00  | 18,81  |
| PHAROL       | 0,145   | -2,16 | -11,27 |
| RAMADA       | 7,680   | -0,26 | 2,40   |
| REN          | 12,580  | -1,10 | -3,97  |
| SEMAPA       | 0,785   | -2,00 | -7,54  |
| SONAE CAP.   | 0,884   | -0,73 | 9,14   |
| SONAE SGPS   | 7,680   | -0,26 | 2,40   |

| MAIORES GANHOS/PERDAS |            |
|-----------------------|------------|
| Título                | Variação % |
| EDP R                 | 1,26       |
| SEMAPA                | -2,00      |
| PHAROL                | -2,16      |
| CTT                   | -2,50      |
| NAVIGATOR             | -2,90      |
| ALTRI                 | -4,61      |



| ÍNDICE     | LAST      | Var. 1D | YTD%   | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|--------|-----------|-----------|
| PSI 20     | 5,045,81  | -1,19%  | 6,64%  | 5,701,90  | 4,551,84  |
| CAC40      | 5,222,12  | -1,70%  | 10,39% | 5,601,38  | 4,555,99  |
| ESTX 50 PR | 3,297,81  | -1,52%  | 9,87%  | 3,540,64  | 2,908,70  |
| XTRA DAX   | 11,837,81 | -1,57%  | 12,11% | 13,170,05 | 10,279,20 |
| S&P 500    | 2,767,62  | -1,24%  | 10,41% | 2,954,13  | 2,346,58  |
| IBEX 35    | 9,080,50  | -1,21%  | 6,33%  | 9,985,90  | 8,286,20  |
| NIKKEI 225 | 21,003,37 | -1,21%  | 4,94%  | 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.