

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

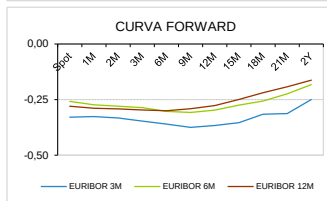
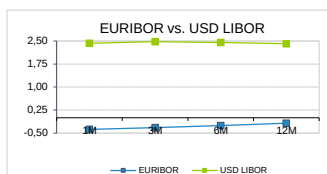
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

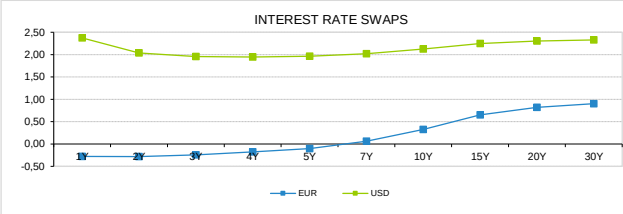
| INTERBANK OFFERED RATES |         |          |          |           |            |          |          |           |           |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M                      | -0,3790 | 0        | -1       | 1M        | 2,4299     | 0        | -4       | 0,7259    | -0,8062   |
| 3M                      | -0,3220 | 0        | -1       | 3M        | 2,4785     | -2       | -8       | 0,7973    | -0,7136   |
| 6M                      | -0,2540 | 0        | -2       | 6M        | 2,4555     | -6       | -16      | 0,8676    | -0,6654   |
| 12M                     | -0,1770 | 0        | -6       | 12M       | 2,4134     | -10      | -33      | 0,9866    | -0,5206   |

| INTEREST RATE SWAPS |         |          |          |         |         |        |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|---------|--------|
| EUR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y      | 3Y      | 5Y     |
| 1Y                  | -0,2800 | 0        | -5       | -0,2782 | -0,0050 | 0,3500 |
| 2Y                  | -0,2820 | -1       | -9       | -0,2194 | 0,0810  | 0,4480 |
| 3Y                  | -0,2420 | -1       | -12      | -0,1480 | 0,1710  | 0,5460 |
| 4Y                  | -0,1780 | -1       | -14      | -0,0690 | 0,2650  | 0,6405 |
| 5Y                  | -0,1030 | -1       | -16      | 0,0150  | 0,3590  | 0,7210 |
| 7Y                  | 0,0620  | -1       | -19      | 0,1940  | 0,5380  | 0,8580 |
| 10Y                 | 0,3240  | -1       | -22      | 0,4470  | 0,7428  | 1,0020 |
| 15Y                 | 0,6520  | -2       | -23      | 0,7280  | 0,9361  | 1,1080 |
| 20Y                 | 0,8210  | -2       | -23      | 0,8625  | 1,0055  | 1,1160 |
| 30Y                 | 0,9020  | -2       | -23      | 0,9129  | 0,9950  | 1,0560 |

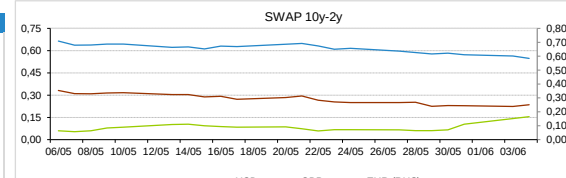
| TAXA DE REFERÊNCIA |       |
|--------------------|-------|
| BANCO CENTRAL      |       |
| Zona Euro          | 0,00  |
| EUA                | 2,50  |
| Reino Unido        | 0,75  |
| Japão              | 0,10  |
| Canadá             | 1,75  |
| Suíça              | -0,75 |
| China              | 5,75  |
| Brasil             | 6,50  |
| Austrália          | 1,25  |
| Índia              | 4,00  |



| INTEREST RATE SWAPS |        |          |          | FORWARDS |        |        |
|---------------------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|
| USD                 | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y       | 3Y     | 5Y     |
| 1Y                  | 2,3730 | 2        | -16      | 1,7214   | 1,8770 | 2,1426 |
| 2Y                  | 2,0360 | -12      | -35      | 1,6785   | 1,9604 | 2,1025 |
| 3Y                  | 1,9560 | -12      | -37      | 1,7350   | 2,0030 | 2,2140 |
| 4Y                  | 1,9460 | -7       | -36      | 1,8240   | 2,0510 | 2,2540 |
| 5Y                  | 1,9620 | -11      | -37      | 1,8820   | 2,0405 | 2,3153 |
| 7Y                  | 2,0200 | -11      | -37      | 2,0043   | 2,1880 | 2,2990 |
| 10Y                 | 2,1240 | -10      | -37      | 2,1320   | 2,2230 | 2,3990 |
| 15Y                 | 2,2460 | -10      | -38      | 2,2145   | 2,2955 | 2,4250 |
| 20Y                 | 2,3020 | -10      | -38      | 2,3050   | 2,3878 | 2,3590 |
| 30Y                 | 2,3270 | -10      | -38      | 2,3269   | 2,3309 | 2,3643 |

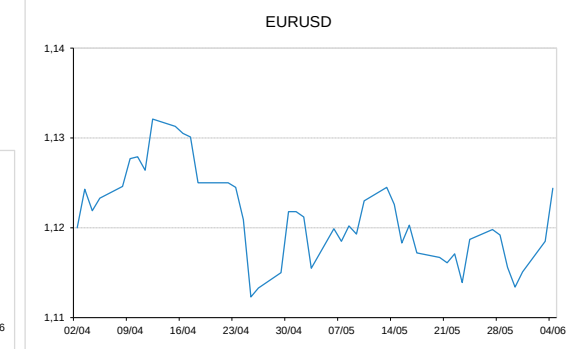
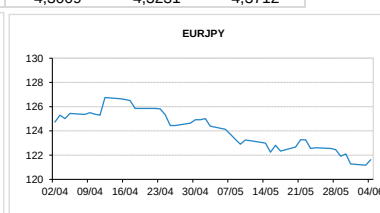


| COMMODITIES | LAST     | Var. 1D | Var. 1M | BONDS      | YIELD  | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT       | 61,79    | 0,51    | -8,24   | OT 2Y      | -0,386 | 0,00     | -5,20    |
| JETFUEL     | 597,05   | -1,73   | -79,48  | OT 5Y      | -0,059 | 0,00     | -14,10   |
| DIESEL      | 564,51   | -1,27   | -85,02  | OT 10Y     | 0,722  | -0,04    | -39,90   |
| COBRE       | 5,867,50 | 12,00   | -394,00 | BUND 10Y   | -0,616 | -0,64    | -22,80   |
| ZINCO       | 2,577,00 | -53,00  | -232,00 | SCHATZ 2Y  | -0,025 | 0,23     | -5,70    |
| OURO        | 1,322,59 | 1,93    | 41,51   | T-NOTE 10Y | 2,899  | 5,33     | -32,70   |
| TRIGO       | 508,75   | -11,00  | 70,75   | T-NOTE 2Y  | 2,204  | 7,28     | -42,60   |
| LICENÇA C02 | 24,57    | 0,83    | -0,63   | GILT 10Y   | 0,901  | 3,52     | -32,80   |



### CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING  | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M  | FW 6M  | FW 12M |
|---------|---------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,1244  | 0,53%   | 0,40%   | 1,1328 | 1,1406 | 1,1554 |
| EUR/GBP | 0,88738 | -0,14%  | -3,68%  | 0,8901 | 0,8930 | 0,8992 |
| EUR/JPY | 121,62  | -0,37%  | 2,06%   | 121,62 | 121,62 | 121,62 |
| EUR/CHF | 1,1169  | 0,11%   | 1,99%   | 1,1158 | 1,1147 | 1,1126 |
| EUR/BRL | 4,3383  | 0,70%   | 2,45%   | 4,4055 | 4,4700 | 4,5896 |
| EUR/PLN | 4,2793  | 0,03%   | 0,12%   | 4,3009 | 4,3231 | 4,3712 |



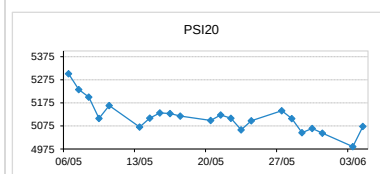
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

|     | EUR    | USD    | GBP    | JPY     | CHF    | SEK     | DKK    | CAD    | AUD    | BRL    | NOK    |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| EUR | -      | 1,1244 | 0,8874 | 121,62  | 1,1169 | 10,6278 | 7,4679 | 1,5077 | 1,6083 | 4,3383 | 9,7902 |
| USD | 0,8902 | -      | 0,7888 | 108,315 | 0,9946 | 9,4619  | 6,6477 | 1,3429 | 1,4330 | 3,8691 | 8,7178 |

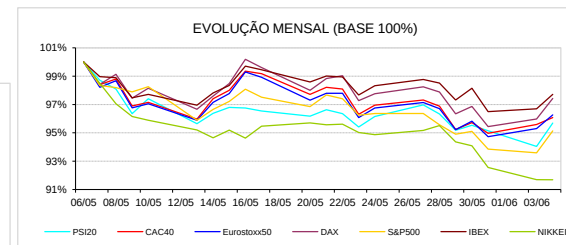
### ACCIONISTA

| TÍTULO       | COTACÃO | 1D %  | YTD %  |
|--------------|---------|-------|--------|
| ALTRI        | 6,100   | 2,26  | 5,17   |
| BCP          | 0,255   | 3,70  | 11,07  |
| CORT. AMORIM | 10,180  | -0,78 | 13,11  |
| CTT          | 2,284   | 0,35  | -22,47 |
| EDP          | 3,324   | 1,56  | 9,02   |
| EDP R        | 9,000   | 1,01  | 15,76  |
| GALP         | 13,380  | 0,07  | -3,01  |
| IBERSOL      | 8,000   | -0,99 | 1,27   |
| J MARTINS    | 13,915  | 1,42  | 34,57  |
| MOTA ENGIL   | 1,950   | 0,78  | 21,12  |
| NAVIGATOR    | 3,230   | 2,15  | -10,28 |
| NOS          | 5,675   | 3,75  | 7,18   |
| NOVABASE     | 2,190   | 2,82  | 8,42   |
| PHAROL       | 0,144   | 0,98  | -11,52 |
| RAMADA       | 7,440   | 2,20  | -0,80  |
| REN          | 12,480  | 2,13  | -4,73  |
| SEMAPA       | 0,752   | 2,17  | -11,43 |
| SONAE CAP.   | 0,890   | 3,13  | 9,88   |
| SONAE SGPS   | 7,440   | 2,20  | -0,80  |

| MAIORES GANHOS/PERDAS |            |
|-----------------------|------------|
| Título                | Variação % |
| NOS                   | 3,75       |
| BCP                   | 3,70       |
| SONAE CAP.            | 3,13       |
| NOVABASE              | 2,82       |
| ALTRI                 | 2,26       |
| CORT. AMORIM          | -0,78      |
| IBERSOL               | -0,99      |



| ÍNDICE     | LAST      | Var. 1D | YTD%   | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|--------|-----------|-----------|
| PSI 20     | 5.072,78  | 1,75%   | 7,21%  | 5.701,90  | 4.551,84  |
| CAC40      | 5.268,26  | 0,51%   | 11,36% | 5.601,38  | 4.555,99  |
| ESTX 50 PR | 3.333,49  | 1,01%   | 11,06% | 3.540,64  | 2.908,70  |
| XTRA DAX   | 11.971,17 | 1,51%   | 13,37% | 13.170,05 | 10.279,20 |
| S&P 500    | 2.789,72  | 1,65%   | 11,29% | 2.954,13  | 2.346,58  |
| IBEX 35    | 9.117,60  | 1,05%   | 6,76%  | 9.985,90  | 8.286,20  |
| NIKKEI 225 | 20.408,54 | -0,01%  | 1,97%  | 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.