

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

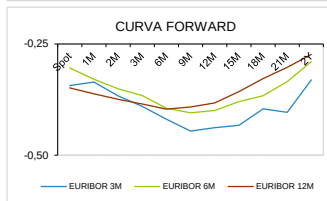
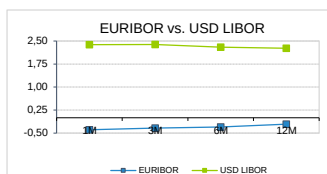
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

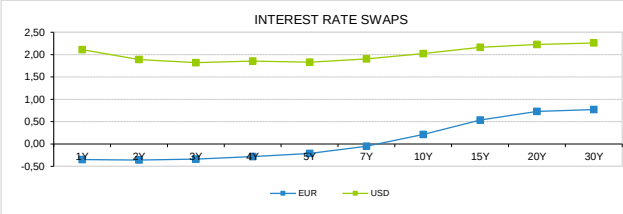
| INTERBANK OFFERED RATES |         |          |          |           |            |          |          |           |           |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M                      | -0,3910 | 0        | -2       | 1M        | 2,3829     | -1       | -6       | 0,7225    | -0,7998   |
| 3M                      | -0,3360 | -1       | -2       | 3M        | 2,3866     | -3       | -14      | 0,7814    | -0,7132   |
| 6M                      | -0,2990 | -2       | -6       | 6M        | 2,2980     | -1       | -26      | 0,8660    | -0,6744   |
| 12M                     | -0,2080 | -2       | -8       | 12M       | 2,2644     | -2       | -37      | 0,9733    | -0,5674   |

| INTEREST RATE SWAPS |         |          |          |         |         |        |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|---------|--------|
| EUR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y      | 3Y      | 5Y     |
| 1Y                  | -0,3485 | 0        | -9       | -0,3829 | -0,0519 | 0,2680 |
| 2Y                  | -0,3590 | -4       | -12      | -0,3275 | -0,0278 | 0,3670 |
| 3Y                  | -0,3370 | -4       | -15      | -0,2532 | 0,1062  | 0,4640 |
| 4Y                  | -0,2810 | -4       | -17      | -0,1643 | 0,1785  | 0,5570 |
| 5Y                  | -0,2120 | -5       | -18      | -0,0780 | 0,2763  | 0,6370 |
| 7Y                  | -0,0490 | -4       | -20      | 0,1040  | 0,4530  | 0,7895 |
| 10Y                 | 0,2110  | -4       | -22      | 0,3580  | 0,6600  | 0,9150 |
| 15Y                 | 0,5360  | -3       | -23      | 0,6393  | 0,8482  | 1,0110 |
| 20Y                 | 0,7280  | 0        | -21      | 0,7687  | 0,9100  | 1,0110 |
| 30Y                 | 0,7700  | -3       | -24      | 0,8040  | 0,8840  | 0,9410 |

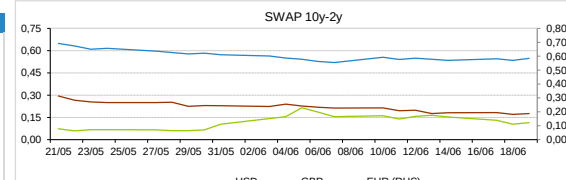
| TAXA DE REFERÊNCIA |       |
|--------------------|-------|
| BANCO CENTRAL      |       |
| Zona Euro          | 0,00  |
| EUA                | 2,50  |
| Reino Unido        | 0,75  |
| Japão              | 0,10  |
| Canadá             | 1,75  |
| Suíça              | -0,75 |
| China              | 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                  | 2,1120 | 3        | -34      | 1,7042   | 1,7820 | 2,0175 |
| 2Y                  | 1,8880 | 2        | -39      | 1,7038   | 1,8405 | 2,0735 |
| 3Y                  | 1,8200 | 1        | -39      | 1,7250   | 1,8990 | 2,1145 |
| 4Y                  | 1,8530 | -7       | -40      | 1,7320   | 1,9155 | 2,1660 |
| 5Y                  | 1,8310 | 0        | -37      | 1,7815   | 1,9870 | 2,2298 |
| 7Y                  | 1,9030 | 0        | -36      | 1,9140   | 2,0765 | 2,2685 |
| 10Y                 | 2,0220 | -1       | -34      | 2,0405   | 2,1950 | 2,3220 |
| 15Y                 | 2,1620 | -1       | -32      | 2,1842   | 2,2690 | 2,3395 |
| 20Y                 | 2,2270 | -1       | -31      | 2,2390   | 2,2930 | 2,3764 |
| 30Y                 | 2,2600 | -1       | -30      | 2,2632   | 2,2900 | 2,3436 |

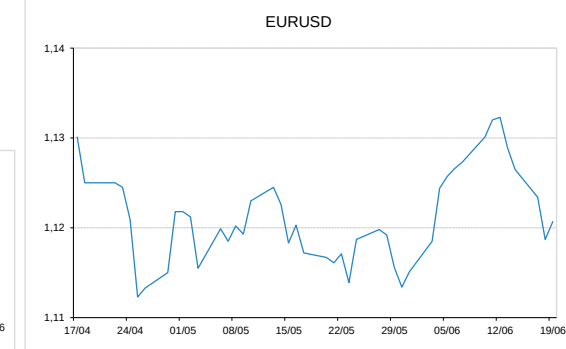
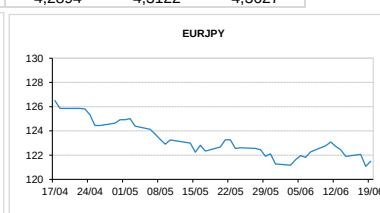


| COMMODITIES | LAST     | Var. 1D | Var. 1M | BONDS      | YIELD  | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT       | 62,19    | 0,05    | -9,07   | OT 2Y      | -0,386 | 0,01     | -2,30    |
| JETFUEL     | 601,66   | 4,41    | -92,09  | OT 5Y      | -0,126 | 0,02     | -18,80   |
| DIESEL      | 566,00   | 4,50    | -93,00  | OT 10Y     | 0,551  | 0,02     | -50,70   |
| COBRE       | 5.956,00 | 104,00  | -107,00 | BUND 10Y   | -0,874 | 4,80     | -21,60   |
| ZINCO       | 2.571,00 | 45,00   | -53,50  | SCHATZ 2Y  | -0,110 | 2,74     | -9,40    |
| OURO        | 1.345,26 | -2,78   | 69,35   | T-NOTE 10Y | 2,852  | 2,81     | -27,00   |
| TRIGO       | 530,50   | -5,00   | 59,25   | T-NOTE 2Y  | 2,214  | 2,88     | -29,10   |
| LICENÇA C02 | 25,01    | -0,11   | 0,01    | GILT 10Y   | 0,860  | 6,55     | -20,60   |



### CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M  | FW 6M  | FW 12M |
|---------|--------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,1207 | 0,18%   | 0,36%   | 1,1291 | 1,1366 | 1,1516 |
| EUR/GBP | 0,8902 | 0,43%   | -1,57%  | 0,8931 | 0,8961 | 0,9028 |
| EUR/JPY | 121,49 | -0,34%  | 0,97%   | 121,49 | 121,49 | 121,49 |
| EUR/CHF | 1,1169 | 0,26%   | 0,83%   | 1,1158 | 1,1148 | 1,1126 |
| EUR/BRL | 4,344  | -0,51%  | 5,28%   | 4,4117 | 4,4741 | 4,5974 |
| EUR/PLN | 4,2683 | -0,21%  | 0,73%   | 4,2894 | 4,3122 | 4,3627 |



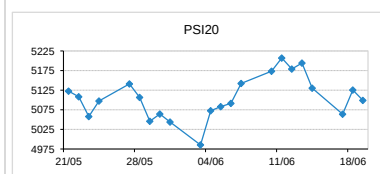
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

|     | EUR    | USD    | GBP    | JPY     | CHF    | SEK     | DKK    | CAD    | AUD     | BRL    | NOK    |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|
| EUR | -      | 1,1207 | 0,8902 | 121,49  | 1,1169 | 10,6838 | 7,4667 | 1,4976 | 1,63249 | 4,3440 | 9,7889 |
| USD | 0,8918 | -      | 0,7917 | 108,415 | 0,9957 | 9,5250  | 6,6589 | 1,3361 | 1,4561  | 3,8770 | 8,7301 |

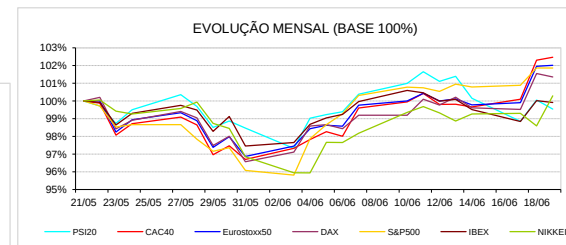
### ACCIONISTA

| TÍTULO       | COTACÃO | 1D %  | YTD %  |
|--------------|---------|-------|--------|
| ALTRI        | 6,160   | -0,08 | 6,21   |
| BCP          | 0,263   | 1,90  | 14,42  |
| CORT. AMORIM | 10,060  | -1,18 | 11,78  |
| CTT          | 2,114   | 0,28  | -28,24 |
| EDP          | 3,408   | -1,50 | 11,77  |
| EDP R        | 9,070   | -0,22 | 16,66  |
| GALP         | 13,050  | -0,42 | -5,40  |
| IBERSOL      | 7,940   | -1,73 | 0,51   |
| J MARTINS    | 14,205  | -2,34 | 37,38  |
| MOTA ENGIL   | 1,900   | 0,05  | 18,01  |
| NAVIGATOR    | 3,236   | -0,25 | -10,11 |
| NOS          | 5,730   | 0,26  | 8,22   |
| NOVABASE     | 2,250   | -2,60 | 11,39  |
| PHAROL       | 0,150   | -2,34 | -7,97  |
| RAMADA       | 7,440   | -2,11 | -0,80  |
| REN          | 12,020  | 0,17  | -8,24  |
| SEMAPA       | 0,715   | -3,38 | -15,78 |
| SONAE CAP.   | 0,862   | -2,38 | 6,36   |
| SONAE SGPS   | 7,440   | -2,11 | -0,80  |

| MAIORES GANHOS/PERDAS |            |
|-----------------------|------------|
| Título                | Variação % |
| BCP                   | 1,90       |
| CTT                   | 0,28       |
| NOS                   | 0,26       |
| REN                   | 0,17       |
| MOTA ENGIL            | 0,05       |
| J MARTINS             | -2,34      |
| PHAROL                | -2,34      |
| SONAE CAP.            | -2,38      |
| NOVABASE              | -2,60      |
| SEMAPA                | -3,38      |



| ÍNDICE     | LAST      | Var. 1D | YTD%   | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|--------|-----------|-----------|
| PSI 20     | 5.098,93  | -0,51%  | 7,77%  | 5.686,45  | 4.551,84  |
| CAC40      | 5.518,45  | 0,16%   | 16,65% | 5.601,38  | 4.555,99  |
| ESTX 50 PR | 3.454,70  | 0,05%   | 15,10% | 3.536,87  | 2.908,70  |
| XTRA DAX   | 12.308,53 | -0,19%  | 16,57% | 12.886,83 | 10.279,20 |
| S&P 500    | 2.917,70  | 0,00%   | 16,39% | 2.954,13  | 2.346,58  |
| IBEX 35    | 9.231,20  | -0,10%  | 8,09%  | 9.971,60  | 8.286,20  |
| NIKKEI 225 | 21.333,87 | 1,72%   | 6,59%  | 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.