

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

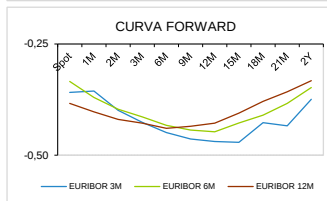
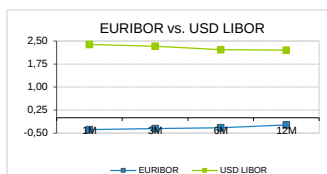
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

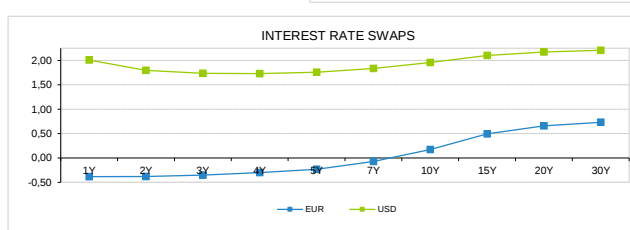
| INTERBANK OFFERED RATES |         |          |          |           |            |          |          |           |           |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M                      | -0,3860 | 1        | -1       | 1M        | 2,3878     | -1       | -4       | 0,7231    | -0,8114   |
| 3M                      | -0,3510 | -1       | -3       | 3M        | 2,3319     | 1        | -17      | 0,7798    | -0,7350   |
| 6M                      | -0,3270 | -1       | -8       | 6M        | 2,2185     | 2        | -30      | 0,8538    | -0,6950   |
| 12M                     | -0,2330 | -2       | -7       | 12M       | 2,2019     | 2        | -31      | 0,9455    | -0,5868   |

| INTEREST RATE SWAPS |         |          |          |         |         |        |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|---------|--------|
| EUR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y      | 3Y      | 5Y     |
| 1Y                  | -0,3830 | 1        | -10      | -0,4293 | -0,1763 | 0,1933 |
| 2Y                  | -0,3820 | -1       | -11      | -0,3800 | -0,0840 | 0,2936 |
| 3Y                  | -0,3530 | -1       | -12      | -0,3116 | 0,0083  | 0,3923 |
| 4Y                  | -0,3010 | -1       | -13      | -0,2308 | 0,1047  | 0,4830 |
| 5Y                  | -0,2320 | -2       | -14      | -0,1459 | 0,2011  | 0,5595 |
| 7Y                  | -0,0730 | -2       | -14      | 0,0355  | 0,3739  | 0,6990 |
| 10Y                 | 0,1740  | -1       | -16      | 0,2857  | 0,5821  | 0,8450 |
| 15Y                 | 0,4930  | 0        | -18      | 0,5708  | 0,7798  | 0,9560 |
| 20Y                 | 0,6580  | 0        | -18      | 0,7089  | 0,8496  | 0,9630 |
| 30Y                 | 0,7310  | 1        | -19      | 0,7576  | 0,8371  | 0,8950 |

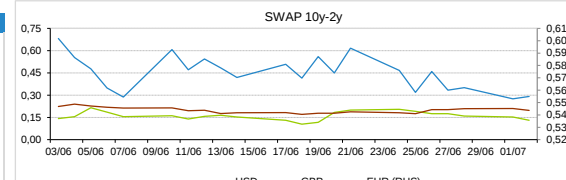
| TAXA DE REFERÊNCIA |       |
|--------------------|-------|
| BANCO CENTRAL      |       |
| Zona Euro          | 0,00  |
| EUA                | 2,50  |
| Reino Unido        | 0,75  |
| Japão              | 0,10  |
| Canadá             | 1,75  |
| Suíça              | -0,75 |
| China              |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



| INTEREST RATE SWAPS |        |          |          | FORWARDS |        |        |
|---------------------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|
| USD                 | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y       | 3Y     | 5Y     |
| 1Y                  | 2,0090 | 1        | -38      | 1,6282   | 1,6770 | 1,9385 |
| 2Y                  | 1,7970 | 1        | -38      | 1,5800   | 1,7345 | 2,0015 |
| 3Y                  | 1,7360 | 1        | -36      | 1,6115   | 1,8040 | 2,0555 |
| 4Y                  | 1,7300 | 1        | -37      | 1,6585   | 1,8670 | 2,1030 |
| 5Y                  | 1,7580 | 0        | -32      | 1,7130   | 1,9240 | 2,1631 |
| 7Y                  | 1,8350 | -1       | -30      | 1,8240   | 2,0190 | 2,2090 |
| 10Y                 | 1,9580 | -1       | -28      | 1,9605   | 2,1270 | 2,2660 |
| 15Y                 | 2,1030 | -1       | -25      | 2,0950   | 2,2110 | 2,3040 |
| 20Y                 | 2,1720 | -1       | -24      | 2,1560   | 2,2430 | 2,3040 |
| 30Y                 | 2,2080 | -1       | -23      | 2,1830   | 2,2360 | 2,2730 |

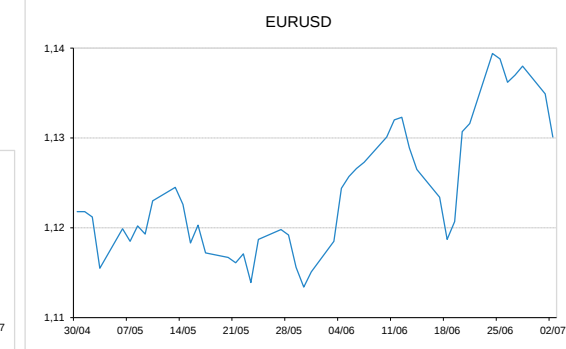
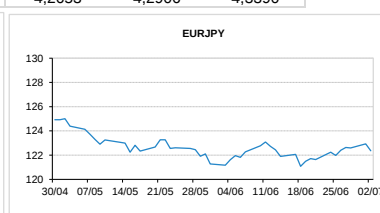


| COMMODITIES | LAST     | Var. 1D | Var. 1M | BONDS      | YIELD  | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT       | 63,01    | -2,05   | 1,85    | OT 2Y      | -0,468 | -0,01    | -7,40    |
| JETFUEL     | 621,07   | -12,22  | 9,57    | OT 5Y      | -0,247 | -0,03    | -20,70   |
| DIESEL      | 582,74   | -15,55  | 2,49    | OT 10Y     | 0,364  | -0,05    | -44,60   |
| COBRE       | 5.941,00 | -38,50  | 124,50  | BUND 10Y   | -0,958 | -0,61    | -18,00   |
| ZINCO       | 2.511,00 | -34,00  | 63,00   | SCHATZ 2Y  | -0,144 | -0,69    | -9,80    |
| OURO        | 1.404,80 | 18,23   | 100,15  | T-NOTE 10Y | 2,768  | -3,73    | -13,10   |
| TRIGO       | 503,50   | -8,25   | -6,25   | T-NOTE 2Y  | 2,130  | -2,11    | -9,90    |
| LICENÇA C02 | 26,71    | -0,21   | 2,25    | GILT 10Y   | 0,717  | -7,66    | -17,70   |



### CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING  | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M  | FW 6M  | FW 12M |
|---------|---------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,1301  | -0,42%  | 1,04%   | 1,1384 | 1,1465 | 1,1607 |
| EUR/GBP | 0,89443 | 0,31%   | -0,92%  | 0,8973 | 0,9004 | 0,9064 |
| EUR/JPY | 122,36  | 0,47%   | -0,97%  | 122,36 | 122,36 | 122,36 |
| EUR/CHF | 1,1141  | 0,08%   | 0,36%   | 1,1129 | 1,1117 | 1,1095 |
| EUR/BRL | 4,361   | -0,57%  | 0,17%   | 4,4323 | 4,4971 | 4,6271 |
| EUR/PLN | 4,2430  | -0,08%  | 0,88%   | 4,2653 | 4,2906 | 4,3390 |



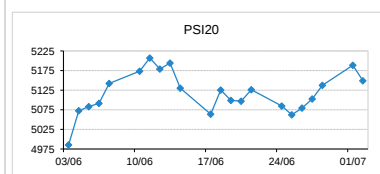
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

|     | EUR    | USD    | GBP    | JPY     | CHF    | SEK     | DKK    | CAD    | AUD     | BRL    | NOK    |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|
| EUR | -      | 1,1301 | 0,8944 | 122,36  | 1,1141 | 10,5341 | 7,4643 | 1,4826 | 1,61641 | 4,3610 | 9,6775 |
| USD | 0,8853 | -      | 0,7939 | 108,115 | 0,9873 | 9,3272  | 6,6078 | 1,3120 | 1,4295  | 3,8564 | 8,5648 |

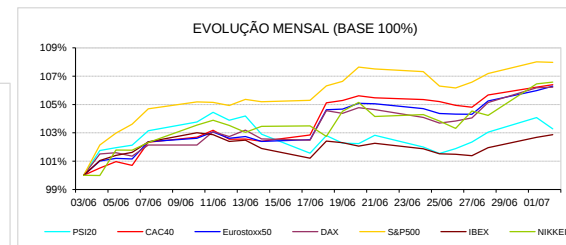
### ACCIONISTA

| TÍTULO       | COTACÃO | 1D %  | YTD %  |
|--------------|---------|-------|--------|
| ALTRI        | 6,200   | -0,48 | 6,90   |
| BCP          | 0,275   | -0,22 | 19,61  |
| CORT. AMORIM | 10,200  | 0,39  | 13,33  |
| CTT          | 2,078   | -3,08 | -29,46 |
| EDP          | 3,395   | 1,34  | 11,35  |
| EDP R        | 8,890   | -0,67 | 14,34  |
| GALP         | 13,615  | -1,13 | -1,30  |
| IBERSOL      | 8,100   | 0,75  | 2,53   |
| J MARTINS    | 13,790  | -5,19 | 33,37  |
| MOTA ENGIL   | 1,892   | -2,32 | 17,52  |
| NAVIGATOR    | 3,412   | 0,06  | -5,22  |
| NOS          | 5,775   | 0,61  | 9,07   |
| NOVABASE     | 2,320   | 0,00  | 14,85  |
| PHAROL       | 0,152   | -0,39 | -6,99  |
| RAMADA       | 7,100   | -1,39 | -5,33  |
| REN          | 12,520  | -0,32 | -4,43  |
| SEMAPA       | 0,722   | -2,43 | -14,96 |
| SONAE CAP.   | 0,856   | -0,93 | 5,68   |
| SONAE SGPS   | 7,100   | -1,39 | -5,33  |

| MAIORES GANHOS/PERDAS |            |
|-----------------------|------------|
| Título                | Variação % |
| EDP                   | 1,34       |
| IBERSOL               | 0,75       |
| NOS                   | 0,61       |
| CORT. AMORIM          | 0,39       |
| NAVIGATOR             | 0,06       |
| RAMADA                | -1,39      |
| MOTA ENGIL            | -2,32      |
| SEMAPA                | -2,43      |
| CTT                   | -3,08      |
| J MARTINS             | -5,19      |



| ÍNDICE     | LAST      | Var. 1D | YTD%   | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|--------|-----------|-----------|
| PSI 20     | 5.149,16  | -0,76%  | 8,83%  | 5.686,45  | 4.551,84  |
| CAC40      | 5.576,82  | 0,16%   | 17,89% | 5.611,28  | 4.555,99  |
| ESTX 50 PR | 3.507,98  | 0,30%   | 16,88% | 3.536,87  | 2.908,70  |
| XTRA DAX   | 12.526,72 | 0,04%   | 18,64% | 12.886,83 | 10.279,20 |
| S&P 500    | 2.963,42  | -0,03%  | 18,21% | 2.977,93  | 2.346,58  |
| IBEX 35    | 9.281,50  | 0,18%   | 8,68%  | 9.971,60  | 8.286,20  |
| NIKKEI 225 | 21.754,27 | 0,11%   | 8,69%  | 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.