

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

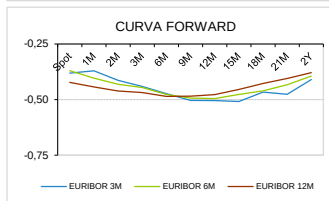
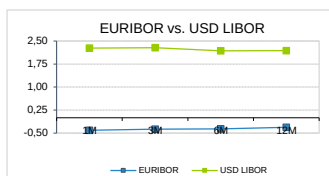
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

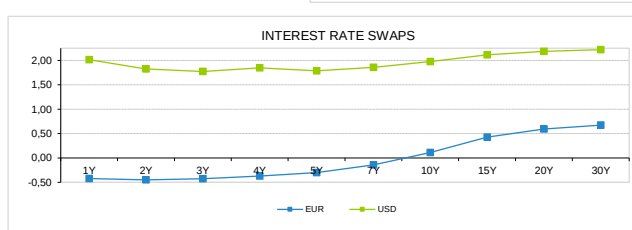
| INTERBANK OFFERED RATES |         |          |          |           |            |          |          |           |           |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M                      | -0,4070 | 0        | -1       | 1M        | 2,2691     | 1        | -14      | 0,7201    | -0,8160   |
| 3M                      | -0,3730 | 0        | -3       | 3M        | 2,2828     | 2        | -7       | 0,7726    | -0,7560   |
| 6M                      | -0,3620 | 0        | -5       | 6M        | 2,1808     | 4        | -4       | 0,8010    | -0,7314   |
| 12M                     | -0,3110 | 0        | -10      | 12M       | 2,1884     | 3        | -1       | 0,8606    | -0,6274   |

| INTEREST RATE SWAPS |         |          |          |         |         |        |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|---------|--------|
| EUR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y      | 3Y      | 5Y     |
| 1Y                  | -0,4230 | 0        | -7       | -0,4803 | -0,2150 | 0,1360 |
| 2Y                  | -0,4490 | -1       | -9       | -0,4310 | -0,1245 | 0,2270 |
| 3Y                  | -0,4250 | -1       | -9       | -0,3579 | -0,0370 | 0,3220 |
| 4Y                  | -0,3700 | 0        | -10      | -0,2761 | 0,0525  | 0,4155 |
| 5Y                  | -0,3010 | 0        | -10      | -0,1932 | 0,1440  | 0,4873 |
| 7Y                  | -0,1410 | 0        | -11      | -0,0188 | 0,3165  | 0,6260 |
| 10Y                 | 0,1100  | 0        | -11      | 0,2259  | 0,5169  | 0,7720 |
| 15Y                 | 0,4280  | 0        | -11      | 0,5050  | 0,7088  | 0,8840 |
| 20Y                 | 0,5950  | -1       | -10      | 0,6453  | 0,7833  | 0,8910 |
| 30Y                 | 0,6730  | -1       | -9       | 0,6910  | 0,7686  | 0,8303 |

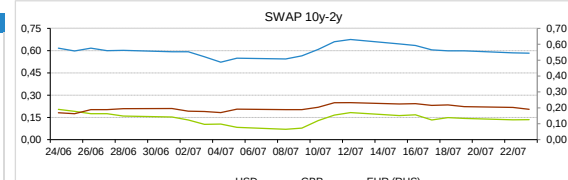
| TAXA DE REFERÊNCIA |       |
|--------------------|-------|
| BANCO CENTRAL      |       |
| Zona Euro          | 0,00  |
| EUA                | 2,50  |
| Reino Unido        | 0,75  |
| Japão              | 0,10  |
| Canadá             | 1,75  |
| Suíça              | -0,75 |
| China              |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



| INTEREST RATE SWAPS |        |          |          |        |        |        |
|---------------------|--------|----------|----------|--------|--------|--------|
| USD                 | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y     | 3Y     | 5Y     |
| 1Y                  | 2,0160 | -5       | -12      | 1,6457 | 1,7355 | 1,9755 |
| 2Y                  | 1,8260 | -3       | -10      | 1,6320 | 1,7977 | 2,0245 |
| 3Y                  | 1,7730 | -2       | -9       | 1,6560 | 1,8430 | 2,0870 |
| 4Y                  | 1,8490 | 3        | 0        | 1,7020 | 1,9228 | 2,1517 |
| 5Y                  | 1,7870 | -2       | -8       | 1,7505 | 1,9783 | 2,1950 |
| 7Y                  | 1,8580 | -2       | -7       | 1,8803 | 2,0574 | 2,2340 |
| 10Y                 | 1,9770 | -2       | -6       | 1,9945 | 2,1756 | 2,2780 |
| 15Y                 | 2,1160 | -2       | -6       | 2,1180 | 2,2340 | 2,3574 |
| 20Y                 | 2,1850 | -2       | -5       | 2,2078 | 2,2650 | 2,3581 |
| 30Y                 | 2,2210 | -1       | -4       | 2,2110 | 2,2625 | 2,2995 |

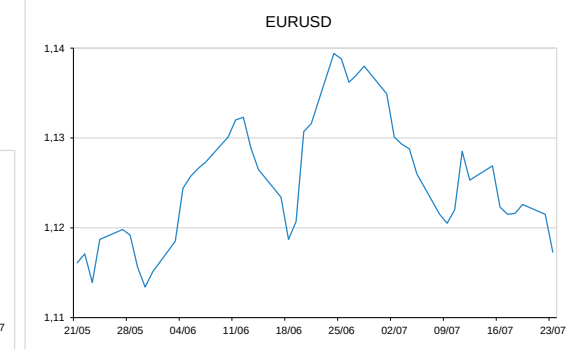
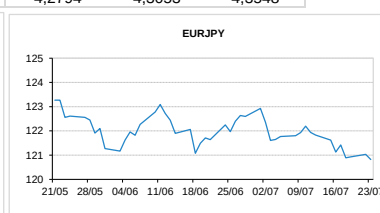


| COMMODITIES | LAST     | Var. 1D | Var. 1M | BONDS      | YIELD  | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT       | 63,15    | -0,11   | -1,30   | OT 2Y      | -0,539 | -0,02    | -17,30   |
| JETFUEL     | 628,75   | -1,50   | 2,50    | OT 5Y      | -0,214 | 0,00     | -12,60   |
| DIESEL      | 589,00   | -0,75   | -1,75   | OT 10Y     | 0,460  | 0,00     | -12,00   |
| COBRE       | 6,019,50 | -47,50  | 46,50   | BUND 10Y   | -0,996 | -0,89    | -12,50   |
| ZINCO       | 2,411,00 | -10,50  | -40,50  | SCHATZ 2Y  | -0,153 | -0,23    | -4,30    |
| OURO        | 1,422,94 | -2,96   | 28,63   | T-NOTE 10Y | 2,821  | 0,62     | -0,20    |
| TRIGO       | 487,50   | 0,25    | -43,25  | T-NOTE 2Y  | 2,210  | 1,34     | 10,00    |
| LICENÇA C02 | 29,79    | 0,80    | 4,49    | GILT 10Y   | 0,679  | -2,48    | -16,70   |



### CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M  | FW 6M  | FW 12M |
|---------|--------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,1173 | -0,37%  | -1,94%  | 1,1254 | 1,1340 | 1,1484 |
| EUR/GBP | 0,8983 | 0,15%   | -0,52%  | 0,9012 | 0,9044 | 0,9103 |
| EUR/JPY | 120,82 | 0,17%   | 1,18%   | 120,82 | 120,82 | 120,82 |
| EUR/CHF | 1,0988 | 0,19%   | 0,84%   | 1,0977 | 1,0963 | 1,0940 |
| EUR/BRL | 4,2047 | -0,27%  | 3,71%   | 4,2698 | 4,3306 | 4,4503 |
| EUR/PLN | 4,2578 | -0,24%  | -0,12%  | 4,2794 | 4,3053 | 4,3548 |



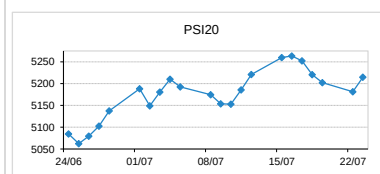
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

|     | EUR    | USD    | GBP    | JPY     | CHF    | SEK     | DKK    | CAD    | AUD     | BRL    | NOK    |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|
| EUR | -      | 1,1173 | 0,8983 | 120,82  | 1,0988 | 10,5594 | 7,4651 | 1,4657 | 1,59399 | 4,2047 | 9,6896 |
| USD | 0,8968 | -      | 0,804  | 108,105 | 0,9848 | 9,4711  | 6,6949 | 1,3141 | 1,4279  | 3,7650 | 8,6911 |

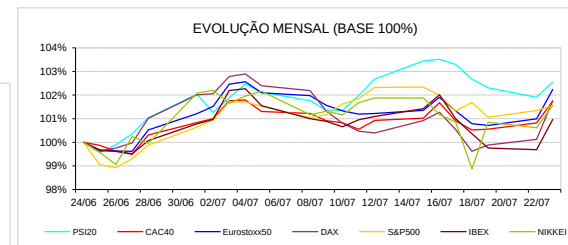
### ACCIONISTA

| TÍTULO       | COTACÃO | 1D % | YTD %  |
|--------------|---------|------|--------|
| ALTRI        | 6,135   | 2,68 | 5,78   |
| BCP          | 0,272   | 1,12 | 18,52  |
| CORT. AMORIM | 9,720   | 0,00 | 8,00   |
| CTT          | 2,046   | 1,99 | -30,55 |
| EDP          | 3,375   | 0,15 | 10,69  |
| EDP R        | 9,220   | 0,22 | 18,59  |
| GALP         | 14,040  | 0,47 | 1,78   |
| IBERSOL      | 8,060   | 0,00 | 2,03   |
| J MARTINS    | 14,660  | 0,41 | 41,78  |
| MOTA ENGIL   | 1,925   | 0,89 | 19,57  |
| NAVIGATOR    | 3,274   | 2,31 | -9,06  |
| NOS          | 5,870   | 0,69 | 10,86  |
| NOVABASE     | 2,370   | 2,16 | 17,33  |
| PHAROL       | 0,154   | 0,92 | -5,64  |
| RAMADA       | 6,940   | 0,00 | -7,47  |
| REN          | 12,520  | 0,81 | -4,43  |
| SEMAPA       | 0,718   | 0,14 | -15,43 |
| SONAE CAP.   | 0,883   | 0,11 | 9,01   |
| SONAE SGPS   | 6,940   | 0,00 | -7,47  |

| MAIORES GANHOS/PERDAS |            |
|-----------------------|------------|
| Título                | Variação % |
| ALTRI                 | 2,68       |
| NAVIGATOR             | 2,31       |
| NOVABASE              | 2,16       |
| CTT                   | 1,99       |
| BCP                   | 1,12       |



| ÍNDICE     | LAST      | Var. 1D | YTD%   | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|--------|-----------|-----------|
| PSI 20     | 5.215,03  | 0,65%   | 10,22% | 5.655,02  | 4.551,84  |
| CAC40      | 5.618,16  | 0,92%   | 18,76% | 5.638,66  | 4.555,99  |
| ESTX 50 PR | 3.532,87  | 1,23%   | 17,71% | 3.549,26  | 2.908,70  |
| XTRA DAX   | 12.490,74 | 1,64%   | 18,30% | 12.886,83 | 10.279,20 |
| S&P 500    | 2.990,98  | 0,20%   | 19,31% | 3.017,80  | 2.346,58  |
| IBEX 35    | 9.281,60  | 1,29%   | 8,69%  | 9.924,40  | 8.286,20  |
| NIKKEI 225 | 21.620,88 | 0,95%   | 8,02%  | 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.