

## AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

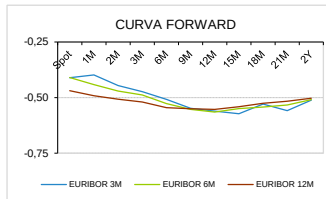
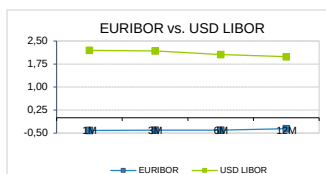
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

### RENTA FIXA

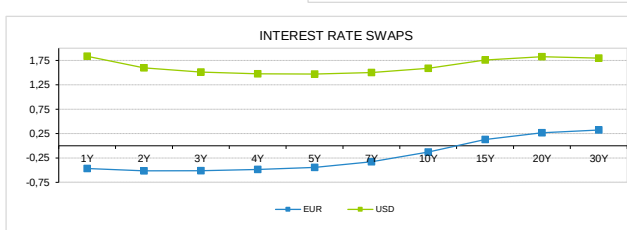
| INTERBANK OFFERED RATES |         |          |          |           |            |          |          |           |           |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M                      | -0,4130 | -1       | -2       | 1M        | 2,1953     | 0        | -14      | 0,7128    | -0,8248   |
| 3M                      | -0,4020 | 0        | -4       | 3M        | 2,1753     | 0        | -15      | 0,7610    | -0,7918   |
| 6M                      | -0,4010 | 0        | -6       | 6M        | 2,0576     | 1        | -17      | 0,7943    | -0,7774   |
| 12M                     | -0,3570 | -1       | -8       | 12M       | 1,9906     | 0        | -24      | 0,8243    | -0,6734   |

| INTEREST RATE SWAPS |         |          |          |         |         |         |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|---------|---------|
| EUR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y      | 3Y      | 5Y      |
| 1Y                  | -0,4680 | 0        | -7       | -0,5530 | -0,4150 | -0,1560 |
| 2Y                  | -0,5140 | -1       | -12      | -0,5280 | -0,3545 | -0,0820 |
| 3Y                  | -0,5110 | -1       | -16      | -0,4900 | -0,2880 | -0,0070 |
| 4Y                  | -0,4860 | -1       | -21      | -0,4405 | -0,2175 | 0,0650  |
| 5Y                  | -0,4430 | -1       | -24      | -0,3830 | -0,1440 | 0,1295  |
| 7Y                  | -0,3280 | -1       | -30      | -0,2528 | -0,0082 | 0,2326  |
| 10Y                 | -0,1300 | 0        | -37      | -0,0642 | 0,1482  | 0,3460  |
| 15Y                 | 0,1280  | -1       | -43      | 0,1511  | 0,3020  | 0,4340  |
| 20Y                 | 0,2670  | -1       | -46      | 0,2595  | 0,3570  | 0,4369  |
| 30Y                 | 0,3230  | -1       | -48      | 0,2837  | 0,3347  | 0,3728  |

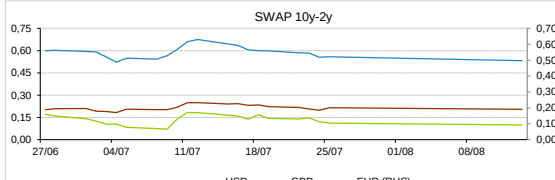
| TAXA DE REFERÊNCIA |       |
|--------------------|-------|
| BANCO CENTRAL      |       |
| Zona Euro          | 0,00  |
| EUA                | 2,25  |
| Reino Unido        | 0,75  |
| Japão              | 0,10  |
| Canadá             | 1,75  |
| Suíça              | -0,75 |
| China              |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



| INTEREST RATE SWAPS |        |          |          | FORWARDS |        |        |
|---------------------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|
| USD                 | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y       | 3Y     | 5Y     |
| 1Y                  | 1,8350 | 0        | -17      | 1,4326   | 1,3670 | 1,4980 |
| 2Y                  | 1,5980 | 0        | -32      | 1,3890   | 1,3940 | 1,5512 |
| 3Y                  | 1,5100 | -1       | -34      | 1,3830   | 1,4260 | 1,5880 |
| 4Y                  | 1,4750 | -1       | -35      | 1,3900   | 1,4620 | 1,6070 |
| 5Y                  | 1,4710 | -2       | -36      | 1,4120   | 1,4980 | 1,6635 |
| 7Y                  | 1,5030 | -3       | -39      | 1,4670   | 1,5856 | 1,7020 |
| 10Y                 | 1,5880 | -4       | -41      | 1,5610   | 1,6530 | 1,7560 |
| 15Y                 | 1,7590 | -13      | -28      | 1,6726   | 1,7300 | 1,8000 |
| 20Y                 | 1,8270 | -14      | -29      | 1,7110   | 1,7590 | 1,8050 |
| 30Y                 | 1,7970 | -7       | -43      | 1,7450   | 1,7711 | 1,7830 |

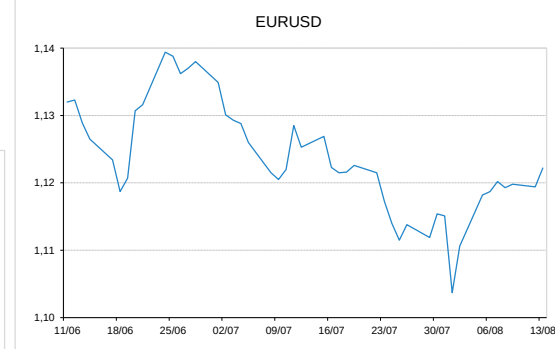
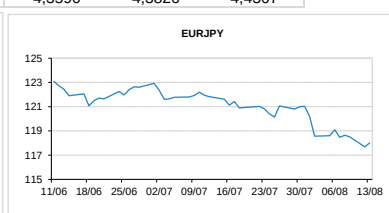


| COMMODITIES | LAST     | Var. 1D | Var. 1M | BONDS      | YIELD  | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT       | 61,00    | 2,43    | -5,34   | OT 2Y      | -0,582 | 0,01     | -14,40   |
| JETFUEL     | 612,90   | 18,40   | -34,02  | OT 5Y      | -0,249 | 0,01     | -18,00   |
| DIESEL      | 580,65   | 17,40   | -28,52  | OT 10Y     | 0,232  | -0,01    | -42,20   |
| COBRE       | 5.740,50 | -13,00  | -193,00 | BUND 10Y   | -1,249 | -1,53    | -11,70   |
| ZINCO       | 2.273,75 | 43,75   | -166,00 | SCHATZ 2Y  | -0,240 | 0,00     | -0,70    |
| OURO        | 1.498,67 | -7,14   | 87,28   | T-NOTE 10Y | 2,596  | 5,48     | -26,70   |
| TRIGO       | 479,75   | 3,50    | -55,25  | T-NOTE 2Y  | 2,095  | 7,83     | 14,00    |
| LICENÇA C02 | 27,09    | 0,39    | -1,70   | GILT 10Y   | 0,484  | 0,43     | -13,40   |



### CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M  | FW 6M  | FW 12M |
|---------|--------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,1222 | 0,25%   | -0,42%  | 1,1301 | 1,1382 | 1,1517 |
| EUR/GBP | 0,9283 | -0,23%  | -3,19%  | 0,9313 | 0,9347 | 0,9408 |
| EUR/JPY | 118,01 | -0,27%  | 3,06%   | 118,01 | 118,01 | 118,01 |
| EUR/CHF | 1,0896 | -0,13%  | 1,76%   | 1,0882 | 1,0866 | 1,0842 |
| EUR/BRL | 4,4243 | 1,01%   | -4,39%  | 4,4876 | 4,5491 | 4,6750 |
| EUR/PLN | 4,3356 | -0,17%  | -1,73%  | 4,3590 | 4,3826 | 4,4307 |



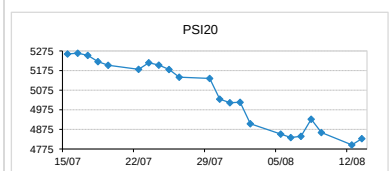
### FIXINGS CONTRA USD e EUR

|     | EUR    | USD    | GBP    | JPY     | CHF    | SEK     | DKK    | CAD    | AUD    | BRL    | NOK    |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|
| EUR | -      | 1,1222 | 0,9283 | 118,01  | 1,0896 | 10,6826 | 7,4633 | 1,4789 | 1,6467 | 4,4243 | 9,9335 |
| USD | 0,8939 | -      | 0,8284 | 106,645 | 0,9744 | 9,5544  | 6,6715 | 1,3231 | 1,4726 | 3,9567 | 8,9109 |

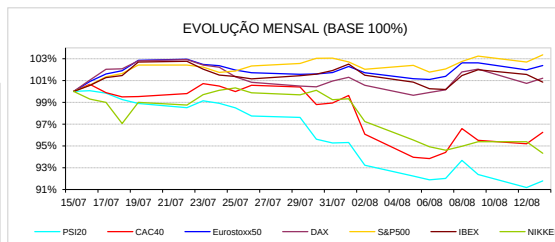
### ACCIONISTA

| TÍTULO       | COTACÃO | 1D %  | YTD %  |
|--------------|---------|-------|--------|
| ALTRI        | 5,585   | 2,48  | -3,71  |
| BCP          | 0,207   | 4,70  | -9,72  |
| CORT. AMORIM | 9,060   | 0,67  | 0,67   |
| CTT          | 1,850   | 2,49  | -37,20 |
| EDP          | 3,391   | 0,53  | 11,22  |
| EDP R        | 9,420   | -2,79 | 21,16  |
| GALP         | 12,910  | 0,62  | -6,42  |
| IBERSOL      | 8,300   | 0,48  | 5,06   |
| J MARTINS    | 14,355  | -0,55 | 38,83  |
| MOTA ENGIL   | 1,818   | 8,02  | 12,92  |
| NAVIGATOR    | 2,914   | 2,68  | -19,06 |
| NOS          | 5,410   | -1,10 | 2,17   |
| NOVABASE     | 2,640   | -2,22 | 30,69  |
| PHAROL       | 0,135   | -3,86 | -17,52 |
| RAMADA       | 6,140   | -0,97 | -18,13 |
| REN          | 11,700  | 2,09  | -10,69 |
| SEMAPA       | 0,630   | -2,17 | -25,80 |
| SONAE CAP.   | 0,801   | 0,44  | -1,17  |
| SONAE SGPS   | 6,140   | -0,97 | -18,13 |

| MAIORES GANHOS/PERDAS |            |
|-----------------------|------------|
| Título                | Variação % |
| MOTA ENGIL            | 8,02       |
| BCP                   | 4,70       |
| NAVIGATOR             | 2,68       |
| CTT                   | 2,49       |
| ALTRI                 | 2,48       |
| NOS                   | -1,10      |
| SEMAPA                | -2,17      |
| NOVABASE              | -2,22      |
| EDP R                 | -2,79      |
| PHAROL                | -3,86      |



| ÍNDICE     | LAST      | Var. 1D | YTD%   | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|--------|-----------|-----------|
| PSI 20     | 4.827,90  | 0,66%   | 2,04%  | 5.593,31  | 4.551,84  |
| CAC40      | 5.369,08  | 1,11%   | 13,49% | 5.672,77  | 4.555,99  |
| ESTX 50 PR | 3.361,14  | 1,04%   | 11,98% | 3.573,57  | 2.908,70  |
| XTRA DAX   | 11.765,23 | 0,74%   | 11,43% | 12.656,05 | 10.279,20 |
| S&P 500    | 2.918,95  | 1,20%   | 16,39% | 3.027,98  | 2.346,58  |
| IBEX 35    | 8.714,80  | 0,44%   | 2,05%  | 9.671,10  | 8.286,20  |
| NIKKEI 225 | 20.455,44 | -1,11%  | 2,20%  | 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.