

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

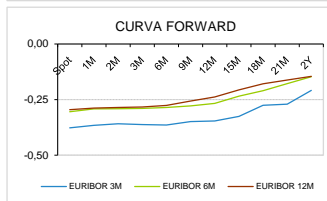
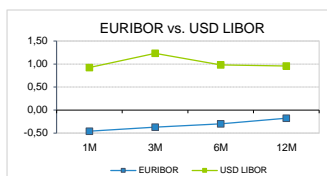
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

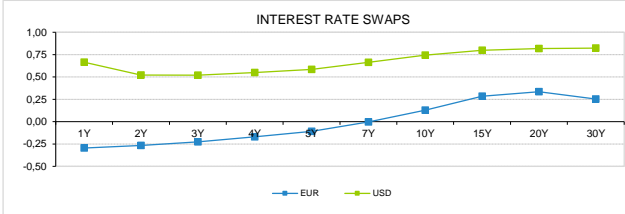
| INTERBANK OFFERED RATES | | | | | | | | | |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M | -0,4580 | 0 | 2 | 1M | 0,9249 | -2 | -69 | 0,2383 | -0,8068 |
| 3M | -0,3690 | 0 | 5 | 3M | 1,2324 | 2 | -41 | 0,5419 | -0,6954 |
| 6M | -0,2980 | 1 | 6 | 6M | 0,9821 | 1 | -65 | 0,6771 | -0,5996 |
| 12M | -0,1760 | 1 | 12 | 12M | 0,9568 | 2 | -68 | 0,7946 | -0,4624 |

| INTEREST RATE SWAPS | | | | | | |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|---------|--------|
| EUR | LAST | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y | 3Y | 5Y |
| 1Y | -0,2950 | 2 | 10 | -0,2416 | -0,0180 | 0,1980 |
| 2Y | -0,2673 | 2 | 14 | -0,1984 | 0,0470 | 0,2488 |
| 3Y | -0,2265 | 1 | 17 | -0,1364 | 0,0970 | 0,2892 |
| 4Y | -0,1702 | 3 | 20 | -0,0740 | 0,1515 | 0,3181 |
| 5Y | -0,1090 | 4 | 24 | -0,0177 | 0,1946 | 0,3660 |
| 7Y | -0,0027 | 4 | 28 | 0,0830 | 0,2704 | 0,4193 |
| 10Y | 0,1291 | 5 | 28 | 0,2052 | 0,3640 | 0,4775 |
| 15Y | 0,2843 | 6 | 23 | 0,3336 | 0,4273 | 0,4805 |
| 20Y | 0,3345 | 7 | 16 | 0,3561 | 0,3964 | 0,4074 |
| 30Y | 0,2523 | 9 | 7 | 0,2553 | 0,2677 | 0,2621 |

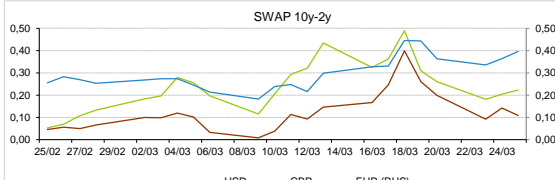
| TAXA DE REFERENCIA | |
|--------------------|-------|
| BANCO CENTRAL | |
| Zona Euro | 0,00 |
| EUA | 0,25 |
| Reino Unido | 0,10 |
| Japão | 0,10 |
| Canadá | 0,75 |
| Suíça | -0,75 |
| China | 5,75 |
| Brasil | 3,75 |
| Austrália | 0,25 |
| Índia | 4,00 |



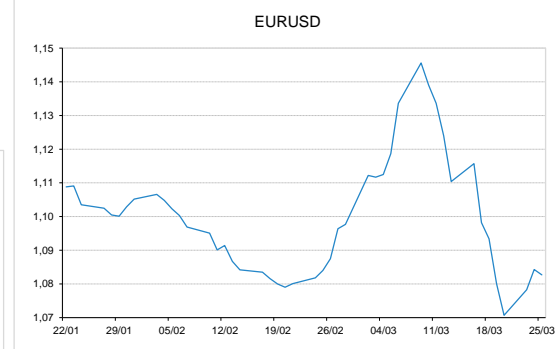
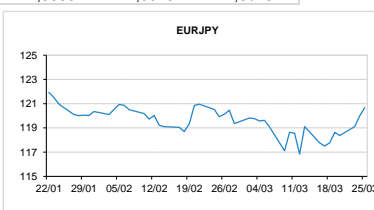
| INTEREST RATE SWAPS | | | | FORWARDS | | |
|---------------------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|
| USD | LAST | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y | 3Y | 5Y |
| 1Y | 0,6641 | 2 | -72 | 0,4136 | 0,6293 | 0,8258 |
| 2Y | 0,5213 | 0 | -69 | 0,4450 | 0,6680 | 0,8510 |
| 3Y | 0,5198 | 0 | -63 | 0,4820 | 0,7218 | 0,8670 |
| 4Y | 0,5486 | 0 | -59 | 0,5560 | 0,7580 | 0,8800 |
| 5Y | 0,5841 | 0 | -56 | 0,6113 | 0,7870 | 0,9110 |
| 7Y | 0,6635 | 1 | -52 | 0,6900 | 0,8367 | 0,9040 |
| 10Y | 0,7441 | 2 | -52 | 0,7610 | 0,8570 | 0,8997 |
| 15Y | 0,7975 | 3 | -56 | 0,8030 | 0,8580 | 0,8850 |
| 20Y | 0,8177 | 4 | -59 | 0,8160 | 0,8550 | 0,8728 |
| 30Y | 0,8223 | 4 | -60 | 0,8164 | 0,8356 | 0,8336 |



| COMMODITIES | LAST | Var. 1D | Var. 1M | BONDS | YIELD | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT | 27,15 | 0,00 | -27,11 | OT 2Y | 0,020 | 0,00 | 47,60 |
| JETFUEL | 254,25 | 6,94 | -257,16 | OT 5Y | 0,542 | -0,02 | 68,80 |
| DIESEL | 307,75 | 11,05 | -179,25 | OT 10Y | 1,054 | -0,02 | 82,90 |
| COBRE | 4.848,00 | 184,00 | -875,00 | BUND 10Y | -0,685 | 5,80 | 23,40 |
| ZINCO | 1.806,75 | -5,50 | -232,00 | SCHATZ 2Y | 0,018 | 2,98 | 6,80 |
| OURO | 1.614,97 | -12,90 | -33,85 | T-NOTE 10Y | 1,874 | -0,14 | -45,70 |
| TRIGO | 579,50 | 18,00 | 42,50 | T-NOTE 2Y | 0,893 | 0,19 | -77,80 |
| LICENÇA C02 | 17,55 | 0,77 | -6,63 | GILT 10Y | 0,407 | -2,33 | -9,00 |


CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M | FW 6M | FW 12M |
|---------|---------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,0827 | -0,15% | -0,12% | 1,0871 | 1,0902 | 1,0958 |
| EUR/GBP | 0,91503 | 0,65% | -8,60% | 0,9173 | 0,9192 | 0,9232 |
| EUR/JPY | 120,67 | -0,56% | -0,62% | 120,67 | 120,67 | 120,67 |
| EUR/CHF | 1,0617 | -0,36% | -0,02% | 1,0609 | 1,0604 | 1,0591 |
| EUR/BRL | 5,4424 | 1,03% | -12,51% | 5,4851 | 5,5222 | 5,6387 |
| EUR/PLN | 4,5697 | 0,77% | -5,83% | 4,5888 | 4,5975 | 4,6078 |


FIXINGS CONTRA USD e EUR

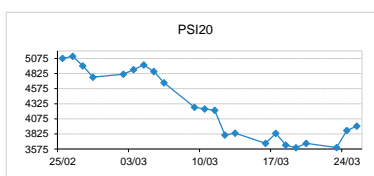
| | EUR | USD | GBP | JPY | CHF | SEK | DKK | CAD | AUD | BRL | NOK |
|-----|--------|--------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|---------|
| EUR | - | 1,0827 | 0,9150 | 120,67 | 1,0617 | 10,9843 | 7,4693 | 1,5493 | 1,81802 | 5,4424 | 11,7190 |
| USD | 0,9254 | - | 0,8547 | 111,56 | 0,9801 | 10,1625 | 6,9104 | 1,4348 | 1,6784 | 5,0736 | 10,9925 |

ACCIONISTA

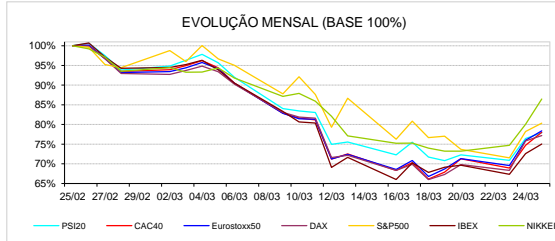
| TITULO | COTACÃO | 1D % | YTD % |
|--------------|---------|-------|--------|
| ALTRI | 3,662 | 5,90 | -35,53 |
| BCP | 0,109 | 1,30 | -46,25 |
| CORT. AMORIM | 7,860 | 2,48 | -30,44 |
| CTT | 1,979 | 2,22 | -37,96 |
| EDP | 3,610 | 4,70 | -6,57 |
| EDP R | 9,750 | 1,99 | -7,14 |
| GALP | 9,622 | 2,43 | -35,42 |
| IBERSOL | 4,950 | -1,00 | -38,13 |
| J MARTINS | 15,655 | -3,27 | 6,75 |
| MOTA ENGIL | 1,130 | 0,62 | -39,57 |
| NAVIGATOR | 2,170 | 2,84 | -37,07 |
| NOS | 3,168 | 1,67 | -34,00 |
| PHAROL | 0,074 | -2,00 | -26,10 |
| RAMADA | 2,700 | 3,85 | -53,77 |
| REN | 2,190 | 6,05 | -19,49 |
| SEMAPA | 7,900 | 2,07 | -42,42 |
| SONAE CAP. | 0,425 | 2,16 | -43,56 |
| SONAE SGPS | 0,591 | -0,67 | -35,11 |

MAIORES GANHOS/PERDAS

| Título | Variação % |
|------------|------------|
| REN | 6,05 |
| ALTRI | 5,90 |
| EDP | 4,70 |
| RAMADA | 3,85 |
| NAVIGATOR | 2,84 |
| SONAE SGPS | -0,67 |
| IBERSOL | -1,00 |
| PHAROL | -2,00 |
| J MARTINS | -3,27 |



| ÍNDICE | LAST | Var. 1D | YTD% | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|---------|-----------|-----------|
| PSI 20 | 3.955,62 | 1,91% | -24,14% | 5.454,21 | 3.500,02 |
| CAC40 | 4.432,30 | 4,47% | -25,86% | 6.111,41 | 3.632,06 |
| ESTX 50 PR | 2.800,14 | 3,13% | -25,23% | 3.867,28 | 2.302,84 |
| XTRA DAX | 9.874,26 | 1,79% | -25,47% | 13.795,24 | 8.255,65 |
| S&P 500 | 2.513,93 | 2,66% | -22,23% | 3.393,52 | 2.191,86 |
| IBEX 35 | 6.942,40 | 3,35% | -27,30% | 10.100,20 | 5.814,50 |
| NIKKEI 225 | 19.546,63 | 8,04% | -17,37% | 24.115,95 | 16.358,19 |



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.