

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

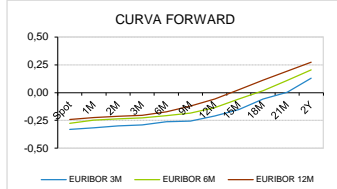
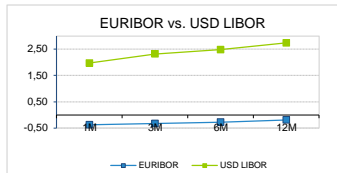
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

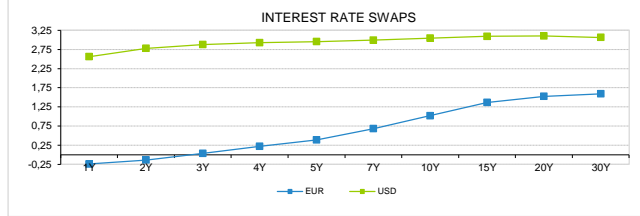
| INTERBANK OFFERED RATES | | | | | | | | | |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M | -0,3690 | 0 | 0 | 1M | 1,9683 | 1 | 7 | 0,4978 | -0,7865 |
| 3M | -0,3230 | 0 | 1 | 3M | 2,3194 | -1 | -4 | 0,6141 | -0,7316 |
| 6M | -0,2710 | 0 | 0 | 6M | 2,4850 | -1 | -3 | 0,7332 | -0,6478 |
| 12M | -0,1880 | 0 | 0 | 12M | 2,7374 | -2 | -3 | 0,9182 | -0,5256 |

| INTEREST RATE SWAPS | | | | | | |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|--------|--------|
| EUR | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y | 3Y | 5Y |
| 1Y | -0,2421 | 1 | 1 | -0,0588 | 0,6410 | 1,2122 |
| 2Y | -0,1340 | 0 | 0 | 0,1065 | 0,8025 | 1,3095 |
| 3Y | 0,0350 | 0 | -2 | 0,2845 | 0,9379 | 1,4075 |
| 4Y | 0,2200 | 0 | -3 | 0,4516 | 1,0500 | 1,4950 |
| 5Y | 0,3900 | 1 | -3 | 0,5985 | 1,1590 | 1,5670 |
| 7Y | 0,6820 | 1 | -3 | 0,8535 | 1,3471 | 1,6905 |
| 10Y | 1,0190 | 1 | -2 | 1,1455 | 1,5365 | 1,8161 |
| 15Y | 1,3670 | 2 | 0 | 1,4284 | 1,6950 | 1,8796 |
| 20Y | 1,5270 | 2 | 2 | 1,5490 | 1,7349 | 1,8450 |
| 30Y | 1,5920 | 2 | 4 | 1,5790 | 1,6990 | 1,7650 |

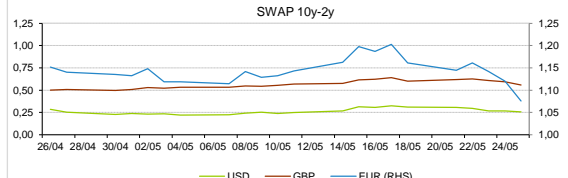
| TAXA DE REFERENCIA | |
|--------------------|-------|
| BANCO CENTRAL | |
| Zona Euro | 0,00 |
| EUA | 1,75 |
| Reino Unido | 0,50 |
| Japão | 0,10 |
| Canadá | 1,25 |
| Suíça | -0,75 |
| China | 5,75 |
| Brasil | 6,50 |
| Austrália | 1,50 |
| Índia | 4,00 |



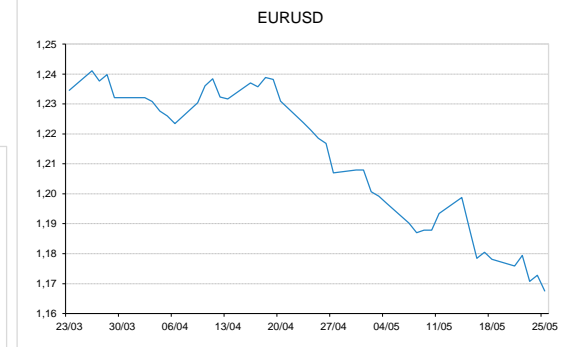
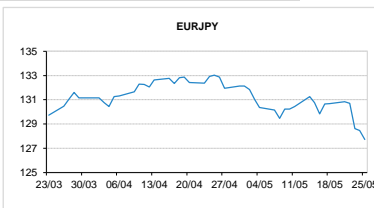
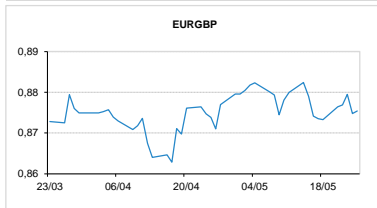
| INTEREST RATE SWAPS | | | | FORWARDS | | |
|---------------------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|
| USD | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y | 3Y | 5Y |
| 1Y | 2,5630 | -1 | 2 | 2,9112 | 2,9717 | 2,9855 |
| 2Y | 2,7780 | -3 | 3 | 2,9286 | 2,9670 | 3,0010 |
| 3Y | 2,8770 | -4 | 3 | 2,9411 | 2,9670 | 3,0297 |
| 4Y | 2,9270 | -4 | 3 | 2,9440 | 3,0052 | 3,0310 |
| 5Y | 2,9550 | -5 | 3 | 2,9480 | 3,0202 | 3,0766 |
| 7Y | 2,9930 | -6 | 3 | 2,9735 | 3,0505 | 3,0740 |
| 10Y | 3,0440 | -6 | 4 | 3,0363 | 3,0772 | 3,0710 |
| 15Y | 3,0910 | -6 | 4 | 3,0400 | 3,0826 | 3,0535 |
| 20Y | 3,1000 | -6 | 4 | 3,0200 | 3,0655 | 3,0235 |
| 30Y | 3,0650 | -6 | 4 | 3,0136 | 2,9715 | 2,9635 |



| COMMODITIES | LAST | Var. 1D | Var. 1M | BONDS | YIELD | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT | 76,20 | -2,59 | 2,97 | OT 2Y | 0,095 | 0,13 | 25,10 |
| JETFUEL | 727,00 | -20,50 | 26,50 | OT 5Y | 0,797 | 0,07 | 17,30 |
| DIESEL | 686,25 | -18,50 | 34,50 | OT 10Y | 1,950 | 0,05 | 23,80 |
| COBRE | 6.910,50 | 13,00 | -133,00 | BUND 10Y | -0,081 | -6,43 | -25,40 |
| ZINCO | 3.041,50 | 8,50 | -170,00 | SCHATZ 2Y | -0,044 | -2,29 | -10,50 |
| OURO | 1.303,95 | -0,87 | -18,39 | T-NOTE 10Y | 3,619 | -3,54 | -8,10 |
| TRIGO | 539,75 | 9,50 | 40,75 | T-NOTE 2Y | 2,828 | -3,51 | -5,50 |
| LICENÇA C02 | 16,03 | -0,26 | 2,77 | GILT 10Y | 1,474 | -7,10 | -23,00 |


CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M | FW 6M | FW 12M |
|---------|--------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,1675 | -0,45% | -4,19% | 1,1759 | 1,1846 | 1,2038 |
| EUR/GBP | 0,8754 | -0,07% | -0,18% | 0,8777 | 0,8803 | 0,8861 |
| EUR/JPY | 127,72 | 0,58% | 4,16% | 127,72 | 127,72 | 127,72 |
| EUR/CHF | 1,1563 | 0,63% | 3,53% | 1,1551 | 1,1538 | 1,1517 |
| EUR/BRL | 4,2685 | 0,20% | -0,66% | 4,3349 | 4,3987 | 4,5400 |
| EUR/PLN | 4,3075 | 0,10% | -1,78% | 4,3306 | 4,3537 | 4,4011 |

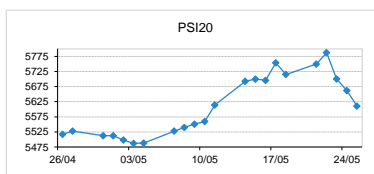

FIXINGS CONTRA USD e EUR

| | EUR | USD | GBP | JPY | CHF | SEK | DKK | CAD | AUD | BRL | NOK |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|
| EUR | - | 1,1675 | 0,8754 | 127,72 | 1,1563 | 10,2084 | 7,4482 | 1,5128 | 1,54353 | 4,2685 | 9,5127 |
| USD | 0,8580 | - | 0,7511 | 109,275 | 0,9915 | 8,7539 | 6,3906 | 1,2981 | 1,3239 | 3,6625 | 8,1484 |

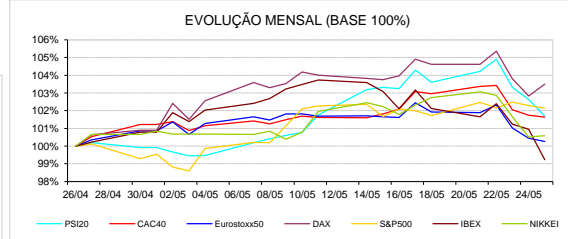
ACCIONISTA

| TITULO | COTACAO | 1D % | YTD % |
|--------------|---------|-------|--------|
| ALTRI | 7,680 | -1,92 | 48,52 |
| BCP | 0,269 | -2,50 | -0,99 |
| CORT. AMORIM | 11,6600 | -0,51 | 13,20 |
| CTT | 2,8620 | -1,04 | -18,39 |
| EDP | 3,420 | 0,41 | 18,54 |
| EDP R | 8,090 | 0,37 | 16,12 |
| GALP | 16,155 | -2,89 | 5,42 |
| IBERSOL | 11,150 | 0,45 | -8,23 |
| J MARTINS | 13,990 | 0,58 | -13,62 |
| MOTA ENGIL | 3,385 | -2,31 | -7,59 |
| NAVIGATOR | 5,360 | 0,37 | 26,06 |
| NOS | 4,706 | -0,17 | -14,14 |
| NOVABASE | 2,800 | -3,78 | -8,17 |
| PHAROL | 0,267 | -2,74 | 6,60 |
| REN | 2,420 | -1,22 | -2,38 |
| SEMAPA | 21,350 | -1,39 | 19,98 |
| SONAE CAP. | 1,006 | -0,40 | 13,42 |
| SONAE SGPS | 1,112 | -2,46 | -1,24 |

| MAIORES GANHOS/PERDAS | |
|-----------------------|------------|
| Título | Variação % |
| J MARTINS | 0,58 |
| IBERSOL | 0,45 |
| EDP | 0,41 |
| NAVIGATOR | 0,37 |
| EDP R | 0,37 |
| SONAE SGPS | -2,46 |
| BCP | -2,50 |
| PHAROL | -2,74 |
| GALP | -2,89 |
| NOVABASE | -3,78 |



| ÍNDICE | LAST | Var. 1D | YTD% | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|--------|-----------|-----------|
| PSI 20 | 5.610,46 | -0,91% | 4,12% | 5.801,45 | 5.014,62 |
| CAC40 | 5.542,55 | -0,11% | 4,33% | 5.657,44 | 4.995,07 |
| ESTX 50 PR | 3.515,36 | -0,18% | 0,33% | 3.708,82 | 3.261,86 |
| XTRA DAX | 12.938,01 | 0,65% | 0,16% | 13.596,89 | 11.726,62 |
| S&P 500 | 2.723,49 | -0,14% | 1,88% | 2.872,87 | 2.403,59 |
| IBEX 35 | 9.826,50 | -1,70% | -2,16% | 11.048,00 | 9.327,60 |
| NIKKEI 225 | 22.450,79 | 0,06% | -1,38% | 24.129,34 | 19.239,52 |



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.