

**AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS**

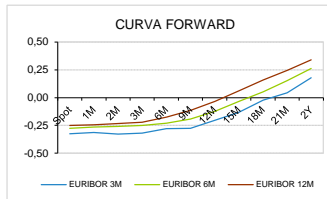
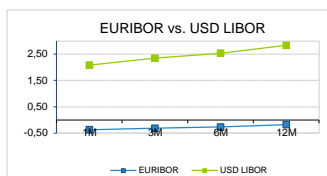
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENDA FIXA**

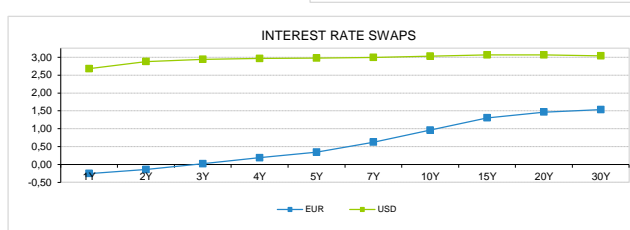
| INTERBANK OFFERED RATES |         |          |          |           |            |          |          |           |           |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M                      | -0,3690 | 0        | 0        | 1M        | 2,0821     | 0        | -1       | 0,6923    | -0,7764   |
| 3M                      | -0,3190 | 0        | 0        | 3M        | 2,3483     | 0        | 1        | 0,8021    | -0,7256   |
| 6M                      | -0,2690 | 0        | 0        | 6M        | 2,5336     | 0        | 3        | 0,9053    | -0,6484   |
| 12M                     | -0,1760 | 0        | 1        | 12M       | 2,8321     | 0        | 7        | 1,0559    | -0,5148   |

| INTEREST RATE SWAPS |         |          |          |         |        |        |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|--------|--------|
| EUR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y      | 3Y     | 5Y     |
| 1Y                  | -0,2509 | 0        | 0        | -0,0362 | 0,6884 | 1,2353 |
| 2Y                  | -0,1410 | 1        | 3        | 0,1515  | 0,8348 | 1,3452 |
| 3Y                  | 0,0210  | 2        | 5        | 0,3301  | 0,9663 | 1,4456 |
| 4Y                  | 0,1900  | 2        | 6        | 0,4911  | 1,0864 | 1,5385 |
| 5Y                  | 0,3480  | 2        | 7        | 0,6366  | 1,1960 | 1,6110 |
| 7Y                  | 0,6260  | 3        | 7        | 0,8906  | 1,3780 | 1,7230 |
| 10Y                 | 0,9600  | 2        | 7        | 1,1830  | 1,5687 | 1,8350 |
| 15Y                 | 1,3060  | 2        | 6        | 1,4611  | 1,7248 | 1,8960 |
| 20Y                 | 1,4670  | 2        | 6        | 1,5776  | 1,7626 | 1,8720 |
| 30Y                 | 1,5340  | 2        | 7        | 1,6074  | 1,7290 | 1,7970 |

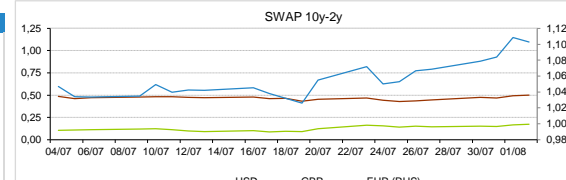
| TAXA DE REFERENCIA |       |
|--------------------|-------|
| BANCO CENTRAL      |       |
| Zona Euro          | 0,00  |
| EUA                | 2,00  |
| Reino Unido        | 0,75  |
| Japão              | 0,10  |
| Canadá             | 1,50  |
| Suíça              | -0,75 |
| China              |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



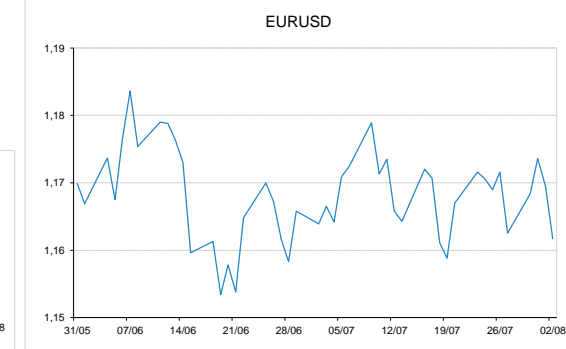
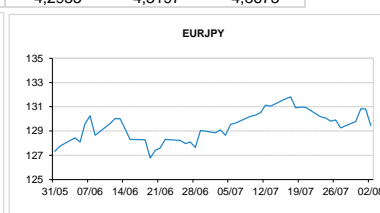
| INTEREST RATE SWAPS |        |          |          | FORWARDS |        |        |
|---------------------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|
| USD                 | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y       | 3Y     | 5Y     |
| 1Y                  | 2,6780 | 0        | 7        | 3,0896   | 3,0644 | 3,0395 |
| 2Y                  | 2,8810 | 0        | 9        | 3,0690   | 3,0370 | 3,0801 |
| 3Y                  | 2,9440 | -1       | 9        | 3,0620   | 3,0360 | 3,0650 |
| 4Y                  | 2,9660 | -1       | 9        | 3,0747   | 3,0430 | 3,1108 |
| 5Y                  | 2,9770 | -1       | 9        | 3,0510   | 3,0530 | 3,1275 |
| 7Y                  | 2,9960 | -1       | 10       | 3,0590   | 3,0800 | 3,1210 |
| 10Y                 | 3,0310 | -1       | 11       | 3,0910   | 3,1296 | 3,1280 |
| 15Y                 | 3,0630 | -1       | 11       | 3,1050   | 3,1100 | 3,1443 |
| 20Y                 | 3,0670 | -1       | 12       | 3,0945   | 3,0865 | 3,0940 |
| 30Y                 | 3,0380 | -2       | 12       | 3,0540   | 3,0410 | 3,0295 |



| COMMODITIES | LAST     | Var. 1D | Var. 1M | BONDS      | YIELD  | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT       | 73,46    | 1,07    | -3,52   | OT 2Y      | -0,148 | 0,01     | -3,50    |
| JETFUEL     | 691,95   | 6,71    | -19,19  | OT 5Y      | 0,593  | 0,03     | -0,30    |
| DIESEL      | 651,70   | 7,71    | -17,19  | OT 10Y     | 1,804  | 0,02     | 6,90     |
| COBRE       | 6.124,00 | -128,00 | -454,00 | BUND 10Y   | -0,098 | -2,98    | 10,40    |
| ZINCO       | 2.568,00 | -68,00  | -294,50 | SCHATZ 2Y  | 0,050  | -1,38    | 9,40     |
| OURO        | 1.213,44 | -4,88   | -28,56  | T-NOTE 10Y | 3,675  | -1,52    | 10,90    |
| TRIGO       | 577,50   | 19,25   | 97,25   | T-NOTE 2Y  | 3,035  | -2,35    | 9,70     |
| LICENÇA C02 | 17,67    | -0,11   | 2,60    | GILT 10Y   | 1,587  | -1,06    | 11,30    |


**CAMBIAL**

| CAMBIAL | FIXING  | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M  | FW 6M  | FW 12M |
|---------|---------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,1617  | -0,68%  | -0,19%  | 1,1698 | 1,1790 | 1,1981 |
| EUR/GBP | 0,89145 | -0,12%  | -0,56%  | 0,8942 | 0,8971 | 0,9036 |
| EUR/JPY | 129,43  | 1,07%   | -0,44%  | 129,43 | 129,43 | 129,43 |
| EUR/CHF | 1,1548  | 0,21%   | 0,01%   | 1,1537 | 1,1525 | 1,1502 |
| EUR/BRL | 4,3635  | 0,20%   | 4,32%   | 4,4353 | 4,5101 | 4,6735 |
| EUR/PLN | 4,2722  | -0,21%  | 3,21%   | 4,2955 | 4,3197 | 4,3673 |

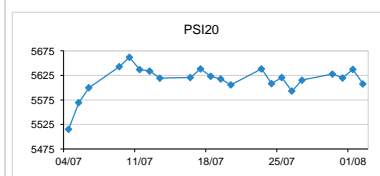

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

|     | EUR    | USD    | GBP    | JPY     | CHF    | SEK     | DKK    | CAD    | AUD     | BRL    | NOK    |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|
| EUR | -      | 1,1617 | 0,8915 | 129,43  | 1,1548 | 10,3048 | 7,4523 | 1,5100 | 1,57413 | 4,3635 | 9,5491 |
| USD | 0,8613 | -      | 0,7673 | 111,465 | 0,9944 | 8,8723  | 6,4185 | 1,3016 | 1,3564  | 3,7608 | 8,2258 |

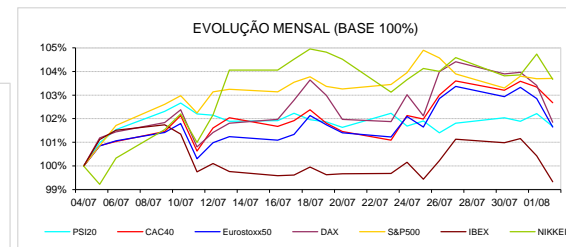
**ACCIONISTA**

| TITULO       | COTACAO | 1D %  | YTD %  |
|--------------|---------|-------|--------|
| ALTRI        | 8,680   | -1,36 | 67,86  |
| BCP          | 0,265   | -1,67 | -2,57  |
| CORT. AMORIM | 10,9600 | -3,18 | 6,41   |
| CTT          | 2,9880  | 0,27  | -14,80 |
| EDP          | 3,541   | 0,23  | 22,74  |
| EDP R        | 8,710   | -0,80 | 25,02  |
| GALP         | 17,735  | 0,00  | 15,73  |
| IBERSOL      | 9,800   | -0,41 | -3,21  |
| J MARTINS    | 12,715  | 0,55  | -21,49 |
| MOTA ENGIL   | 2,885   | 0,35  | -21,24 |
| NAVIGATOR    | 4,866   | -0,98 | 15,30  |
| NOS          | 4,970   | 0,20  | -9,32  |
| NOVABASE     | 2,690   | 0,00  | -11,77 |
| PHAROL       | 0,230   | 0,44  | -8,20  |
| REN          | 2,496   | -0,16 | 0,69   |
| SEMAPA       | 20,300  | -0,25 | 14,08  |
| SONAE CAP.   | 0,895   | 0,00  | 0,90   |
| SONAE SGPS   | 0,973   | -1,67 | -13,63 |

| MAIORES GANHOS/PERDAS |           |
|-----------------------|-----------|
| Título                | Varição % |
| J MARTINS             | 0,55      |
| PHAROL                | 0,44      |
| MOTA ENGIL            | 0,35      |
| CTT                   | 0,27      |
| EDP                   | 0,23      |
| NAVIGATOR             | -0,98     |
| ALTRI                 | -1,36     |
| SONAE SGPS            | -1,67     |
| BCP                   | -1,67     |
| CORT. AMORIM          | -3,18     |



| ÍNDICE     | LAST      | Var. 1D | YTD%   | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|--------|-----------|-----------|
| PSI 20     | 5.607,48  | -0,53%  | 4,07%  | 5.801,45  | 5.014,62  |
| CAC40      | 5.463,02  | -0,64%  | 2,83%  | 5.657,44  | 4.995,07  |
| ESTX 50 PR | 3.468,31  | -1,17%  | -1,02% | 3.708,82  | 3.261,86  |
| XTRA DAX   | 12.545,81 | -1,51%  | -2,89% | 13.596,89 | 11.726,62 |
| S&P 500    | 2.814,72  | 0,02%   | 5,24%  | 2.872,87  | 2.417,35  |
| IBEX 35    | 9.691,90  | -1,10%  | -3,50% | 10.758,20 | 9.327,60  |
| NIKKEI 225 | 22.512,53 | -1,03%  | -1,11% | 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.