

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

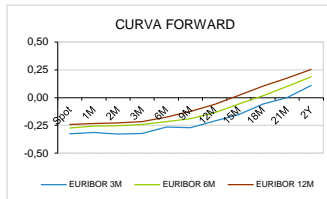
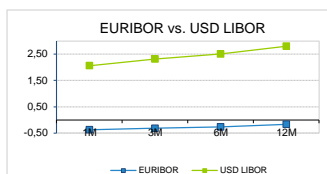
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

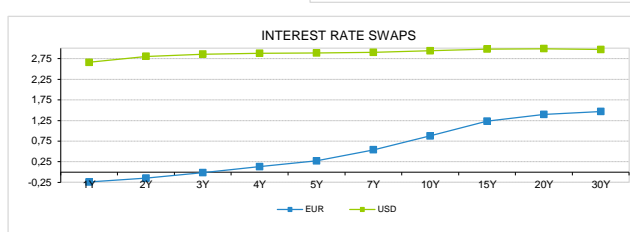
| INTERBANK OFFERED RATES | | | | | | | | | |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M | -0,3700 | 0 | 0 | 1M | 2,0627 | 0 | -1 | 0,7208 | -0,7782 |
| 3M | -0,3190 | 0 | 0 | 3M | 2,3138 | -1 | -2 | 0,8088 | -0,7272 |
| 6M | -0,2660 | 0 | 0 | 6M | 2,5076 | 0 | -1 | 0,9009 | -0,6500 |
| 12M | -0,1660 | 0 | 1 | 12M | 2,8030 | -1 | 2 | 1,0356 | -0,5164 |

| INTEREST RATE SWAPS | | | | | | |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|--------|--------|
| EUR | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y | 3Y | 5Y |
| 1Y | -0,2426 | 0 | 1 | -0,0589 | 0,5680 | 1,1100 |
| 2Y | -0,1460 | 0 | 3 | 0,0967 | 0,7060 | 1,2275 |
| 3Y | -0,0130 | -1 | 2 | 0,2528 | 0,8390 | 1,3335 |
| 4Y | 0,1300 | -1 | 2 | 0,4000 | 0,9650 | 1,4290 |
| 5Y | 0,2710 | -1 | 1 | 0,5400 | 1,0790 | 1,5110 |
| 7Y | 0,5390 | -2 | 1 | 0,7940 | 1,2740 | 1,6390 |
| 10Y | 0,8760 | -2 | 2 | 1,0940 | 1,4799 | 1,7600 |
| 15Y | 1,2310 | -2 | 1 | 1,3859 | 1,6492 | 1,8280 |
| 20Y | 1,3970 | -2 | 1 | 1,5083 | 1,6920 | 1,8080 |
| 30Y | 1,4680 | -2 | 0 | 1,5433 | 1,6620 | 1,7330 |

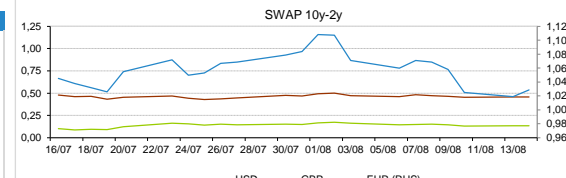
| TAXA DE REFERENCIA | |
|--------------------|-------|
| BANCO CENTRAL | |
| Zona Euro | 0,00 |
| EUA | 2,00 |
| Reino Unido | 0,75 |
| Japão | 0,10 |
| Canadá | 1,50 |
| Suíça | -0,75 |
| China | 5,75 |
| Brasil | 6,50 |
| Austrália | 1,50 |
| Índia | 4,00 |



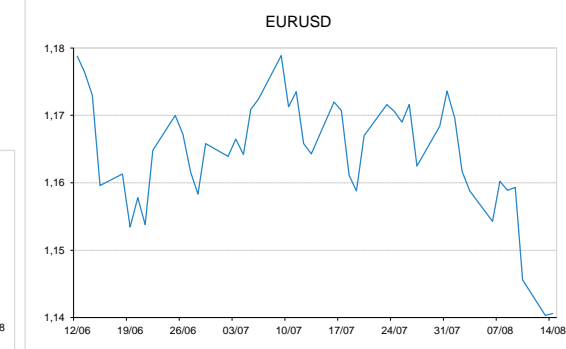
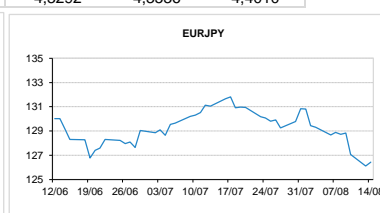
| INTEREST RATE SWAPS | | | | FORWARDS | | |
|---------------------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|
| USD | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y | 3Y | 5Y |
| 1Y | 2,6580 | -1 | 3 | 3,0119 | 2,9070 | 2,9245 |
| 2Y | 2,8040 | -5 | -2 | 2,9855 | 2,9363 | 2,9390 |
| 3Y | 2,8570 | -5 | -2 | 2,9430 | 2,9410 | 2,9550 |
| 4Y | 2,8760 | -5 | -2 | 2,9664 | 2,9496 | 3,0012 |
| 5Y | 2,8840 | -5 | -2 | 2,9629 | 2,9622 | 3,0205 |
| 7Y | 2,9020 | -5 | -1 | 2,9715 | 2,9929 | 3,0220 |
| 10Y | 2,9390 | -5 | 0 | 3,0056 | 3,0256 | 3,0360 |
| 15Y | 2,9820 | -5 | 1 | 3,0303 | 3,0393 | 3,0320 |
| 20Y | 2,9910 | -5 | 2 | 3,0297 | 3,0050 | 3,0330 |
| 30Y | 2,9690 | -5 | 3 | 2,9975 | 2,9888 | 2,9600 |



| COMMODITIES | LAST | Var. 1D | Var. 1M | BONDS | YIELD | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT | 72,68 | 0,07 | -2,58 | OT 2Y | -0,149 | -0,03 | -2,80 |
| JETFUEL | 694,25 | 5,41 | -6,34 | OT 5Y | 0,629 | -0,03 | 8,80 |
| DIESEL | 659,25 | 3,91 | 1,41 | OT 10Y | 1,814 | -0,03 | 7,90 |
| COBRE | 6.129,50 | -36,50 | -83,50 | BUND 10Y | -0,238 | 1,10 | -1,70 |
| ZINCO | 2.493,50 | -64,50 | -86,50 | SCHATZ 2Y | -0,016 | 0,46 | -0,20 |
| OURO | 1.196,69 | 3,25 | -45,46 | T-NOTE 10Y | 3,587 | 1,34 | 2,50 |
| TRIGO | 554,75 | 1,25 | 42,25 | T-NOTE 2Y | 2,992 | 1,17 | 1,90 |
| LICENÇA C02 | 18,13 | 0,07 | 2,07 | GILT 10Y | 1,477 | 0,19 | -1,70 |


CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M | FW 6M | FW 12M |
|---------|--------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,1406 | 0,03% | -2,68% | 1,1486 | 1,1579 | 1,1762 |
| EUR/GBP | 0,893 | 0,03% | -1,15% | 0,8958 | 0,8987 | 0,9048 |
| EUR/JPY | 126,42 | -0,25% | 4,14% | 126,42 | 126,42 | 126,42 |
| EUR/CHF | 1,1273 | 0,45% | 3,54% | 1,1262 | 1,1249 | 1,1226 |
| EUR/BRL | 4,4085 | 0,52% | 2,53% | 4,4775 | 4,5508 | 4,7150 |
| EUR/PLN | 4,3052 | 0,32% | 0,10% | 4,3292 | 4,3536 | 4,4010 |

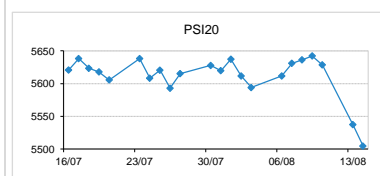

FIXINGS CONTRA USD e EUR

| | EUR | USD | GBP | JPY | CHF | SEK | DKK | CAD | AUD | BRL | NOK |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|
| EUR | - | 1,1406 | 0,8930 | 126,42 | 1,1273 | 10,3606 | 7,4555 | 1,4875 | 1,56774 | 4,4085 | 9,5356 |
| USD | 0,8792 | - | 0,7842 | 110,885 | 0,9929 | 9,1073 | 6,5546 | 1,3084 | 1,3779 | 3,8736 | 8,3787 |

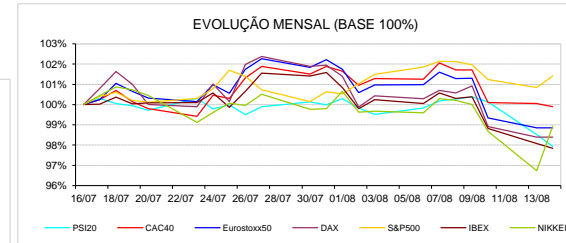
ACCIONISTA

| TITULO | COTACÃO | 1D % | YTD % |
|--------------|---------|-------|--------|
| ALTRI | 8,570 | -1,15 | 65,73 |
| BCP | 0,257 | -1,15 | -5,51 |
| CORT. AMORIM | 10,6400 | 0,95 | 3,30 |
| CTT | 3,1640 | 0,25 | -9,78 |
| EDP | 3,410 | -0,41 | 18,20 |
| EDP R | 8,800 | 0,23 | 26,31 |
| GALP | 17,685 | 0,14 | 15,40 |
| IBERSOL | 9,580 | -0,62 | -5,38 |
| J MARTINS | 12,835 | -0,70 | -20,75 |
| MOTA ENGIL | 2,815 | -1,23 | -23,15 |
| NAVIGATOR | 4,496 | -2,30 | 6,54 |
| NOS | 4,926 | 0,20 | -10,13 |
| NOVABASE | 2,670 | -0,74 | -12,43 |
| PHAROL | 0,225 | -0,66 | -10,00 |
| REN | 2,450 | 0,16 | -1,17 |
| SEMAPA | 18,440 | -2,02 | 3,62 |
| SONAE CAP. | 0,857 | 0,00 | -3,38 |
| SONAE SGPS | 0,954 | -2,80 | -15,32 |

| MAIORES GANHOS/PERDAS | |
|-----------------------|------------|
| Título | Variação % |
| CORT. AMORIM | 0,95 |
| CTT | 0,25 |
| EDP R | 0,23 |
| NOS | 0,20 |
| REN | 0,16 |
| BCP | -1,15 |
| MOTA ENGIL | -1,23 |
| SEMAPA | -2,02 |
| NAVIGATOR | -2,30 |
| SONAE SGPS | -2,80 |



| ÍNDICE | LAST | Var. 1D | YTD% | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|--------|-----------|-----------|
| PSI 20 | 5.504,50 | -0,59% | 2,16% | 5.801,45 | 5.014,62 |
| CAC40 | 5.403,41 | -0,16% | 1,71% | 5.657,44 | 4.995,07 |
| ESTX 50 PR | 3.409,44 | -0,01% | -2,70% | 3.708,82 | 3.261,86 |
| XTRA DAX | 12.358,87 | 0,00% | -4,33% | 13.596,89 | 11.726,62 |
| S&P 500 | 2.838,15 | 0,57% | 6,15% | 2.872,87 | 2.417,35 |
| IBEX 35 | 9.507,00 | -0,25% | -5,35% | 10.643,40 | 9.327,60 |
| NIKKEI 225 | 22.356,08 | 2,28% | -1,80% | 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.