

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

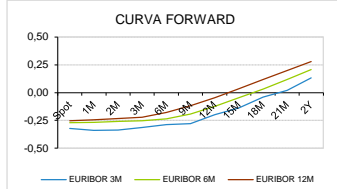
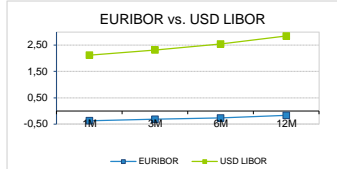
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

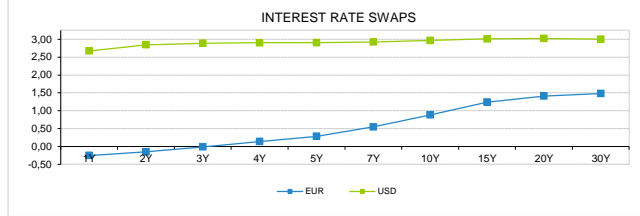
| INTERBANK OFFERED RATES | | | | | | | | | |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M | -0,3710 | 0 | 0 | 1M | 2,1205 | 0 | 4 | 0,7236 | -0,7806 |
| 3M | -0,3190 | 0 | 0 | 3M | 2,3168 | -1 | -3 | 0,8010 | -0,7284 |
| 6M | -0,2690 | 0 | 0 | 6M | 2,5406 | 0 | 2 | 0,8923 | -0,6498 |
| 12M | -0,1670 | 0 | 1 | 12M | 2,8439 | 0 | 2 | 1,0386 | -0,5178 |

| INTEREST RATE SWAPS | | | | | | |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|--------|--------|
| EUR | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y | 3Y | 5Y |
| 1Y | -0,2522 | 0 | -1 | -0,0466 | 0,5967 | 1,1242 |
| 2Y | -0,1490 | 0 | -1 | 0,1173 | 0,7376 | 1,2366 |
| 3Y | -0,0100 | 0 | -2 | 0,2769 | 0,8647 | 1,3368 |
| 4Y | 0,1400 | 0 | -3 | 0,4259 | 0,9839 | 1,4312 |
| 5Y | 0,2850 | 1 | -4 | 0,5627 | 1,0924 | 1,5070 |
| 7Y | 0,5500 | 1 | -5 | 0,8079 | 1,2847 | 1,6451 |
| 10Y | 0,8840 | 1 | -6 | 1,1039 | 1,4835 | 1,7694 |
| 15Y | 1,2430 | 0 | -5 | 1,3901 | 1,6507 | 1,8411 |
| 20Y | 1,4100 | 0 | -4 | 1,5165 | 1,6996 | 1,8206 |
| 30Y | 1,4820 | 0 | -4 | 1,5524 | 1,6721 | 1,7446 |

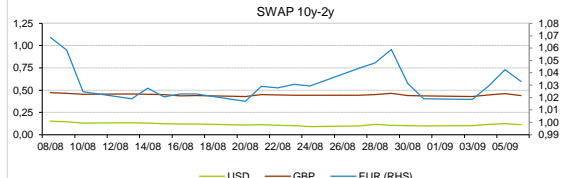
| TAXA DE REFERENCIA | |
|--------------------|-------|
| BANCO CENTRAL | |
| Zona Euro | 0,00 |
| EUA | 2,00 |
| Reino Unido | 0,75 |
| Japão | 0,10 |
| Canadá | 1,50 |
| Suíça | -0,75 |
| China | 5,75 |
| Brasil | 6,50 |
| Austrália | 1,50 |
| Índia | 4,00 |



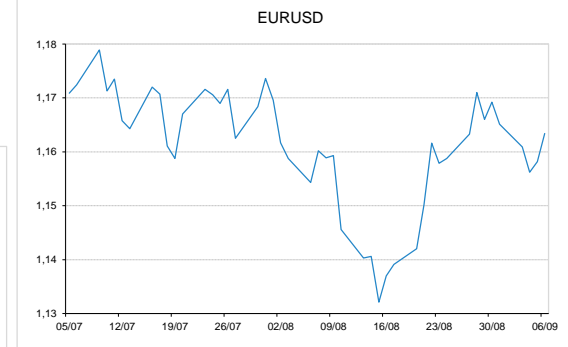
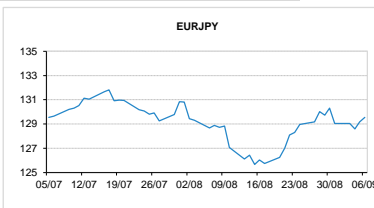
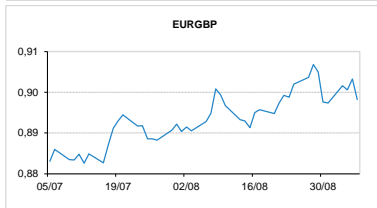
| INTEREST RATE SWAPS | | | | FORWARDS | | |
|---------------------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|
| USD | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y | 3Y | 5Y |
| 1Y | 2,6740 | 1 | 0 | 3,0022 | 2,8825 | 2,9055 |
| 2Y | 2,8440 | 2 | -2 | 2,9430 | 2,8805 | 2,9230 |
| 3Y | 2,8870 | 2 | -4 | 2,9230 | 2,8850 | 2,9400 |
| 4Y | 2,9000 | 3 | -5 | 2,9334 | 2,9232 | 2,9890 |
| 5Y | 2,9050 | 3 | -6 | 2,9319 | 2,9190 | 3,0105 |
| 7Y | 2,9240 | 4 | -6 | 2,9479 | 2,9776 | 3,0130 |
| 10Y | 2,9650 | 5 | -6 | 2,9877 | 3,0148 | 3,0315 |
| 15Y | 3,0100 | 5 | -6 | 2,9970 | 3,0338 | 3,0300 |
| 20Y | 3,0200 | 6 | -6 | 3,0230 | 3,0010 | 3,0090 |
| 30Y | 2,9990 | 6 | -5 | 2,9700 | 2,9640 | 2,9630 |



| COMMODITIES | LAST | Var. 1D | Var. 1M | BONDS | YIELD | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT | 75,87 | -1,40 | 1,80 | OT 2Y | -0,119 | 0,00 | 3,90 |
| JETFUEL | 728,83 | -12,60 | 34,25 | OT 5Y | 0,670 | 0,01 | 10,30 |
| DIESEL | 692,83 | -11,85 | 36,75 | OT 10Y | 1,881 | 0,01 | 12,80 |
| COBRE | 5.882,50 | 56,00 | -335,00 | BUND 10Y | -0,030 | -3,60 | -6,70 |
| ZINCO | 2.430,00 | 2,00 | -217,00 | SCHATZ 2Y | 0,050 | -1,38 | -1,40 |
| OURO | 1.198,94 | 3,43 | -11,12 | T-NOTE 10Y | 3,580 | -2,52 | -10,00 |
| TRIGO | 516,00 | -5,75 | -81,25 | T-NOTE 2Y | 3,047 | -2,35 | -7,80 |
| LICENÇA C02 | 21,57 | 1,20 | 4,00 | GILT 10Y | 1,563 | -4,83 | -7,00 |


CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M | FW 6M | FW 12M |
|---------|---------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,1634 | 0,45% | 0,79% | 1,1715 | 1,1809 | 1,2003 |
| EUR/GBP | 0,89824 | 0,56% | -0,61% | 0,9010 | 0,9040 | 0,9104 |
| EUR/JPY | 129,55 | -0,29% | -0,67% | 129,55 | 129,55 | 129,55 |
| EUR/CHF | 1,1252 | 0,36% | 2,40% | 1,1240 | 1,1229 | 1,1207 |
| EUR/BRL | 4,819 | 0,14% | -10,41% | 4,8962 | 4,9751 | 5,1687 |
| EUR/PLN | 4,3287 | -0,02% | -1,68% | 4,3506 | 4,3739 | 4,4226 |

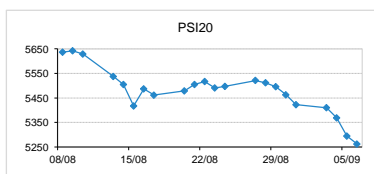

FIXINGS CONTRA USD e EUR

| | EUR | USD | GBP | JPY | CHF | SEK | DKK | CAD | AUD | BRL | NOK |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|
| EUR | - | 1,1634 | 0,8982 | 129,55 | 1,1252 | 10,5890 | 7,4560 | 1,5356 | 1,61448 | 4,8190 | 9,7889 |
| USD | 0,8594 | - | 0,7721 | 110,895 | 0,9676 | 9,1004 | 6,4086 | 1,3197 | 1,3873 | 4,1538 | 8,4098 |

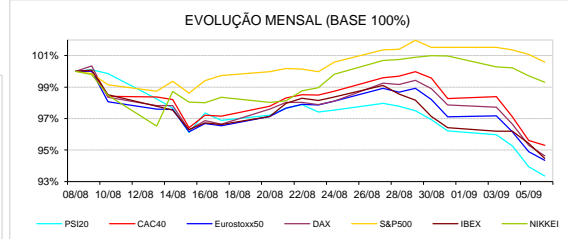
ACCIONISTA

| TITULO | COTACÃO | 1D % | YTD % |
|--------------|---------|-------|--------|
| ALTRI | 7,710 | -0,39 | 49,10 |
| BCP | 0,250 | -0,12 | -8,09 |
| CORT. AMORIM | 11,2000 | 2,19 | 8,74 |
| CTT | 3,2220 | -3,65 | -8,13 |
| EDP | 3,294 | -0,33 | 14,18 |
| EDP R | 8,385 | 0,42 | 20,35 |
| GALP | 16,405 | -2,55 | 7,05 |
| IBERSOL | 9,320 | 1,75 | -7,95 |
| J MARTINS | 12,430 | -0,04 | -23,25 |
| MOTA ENGIL | 2,200 | -5,38 | -39,94 |
| NAVIGATOR | 4,126 | -1,10 | -2,23 |
| NOS | 4,864 | 0,16 | -11,26 |
| NOVABASE | 2,720 | 1,12 | -10,79 |
| PHAROL | 0,190 | 1,60 | -24,00 |
| REN | 2,418 | -0,25 | -2,46 |
| SEMAPA | 17,580 | -0,68 | -1,21 |
| SONAE CAP. | 0,805 | 0,63 | -9,24 |
| SONAE SGPS | 0,902 | -0,99 | -19,94 |

| MAIORES GANHOS/PERDAS | |
|-----------------------|------------|
| Título | Variação % |
| CORT. AMORIM | 2,19 |
| IBERSOL | 1,75 |
| PHAROL | 1,60 |
| NOVABASE | 1,12 |
| SONAE CAP. | 0,63 |
| SONAE SGPS | -0,99 |
| NAVIGATOR | -1,10 |
| GALP | -2,55 |
| CTT | -3,65 |
| MOTA ENGIL | -5,38 |



| ÍNDICE | LAST | Var. 1D | YTD% | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|--------|-----------|-----------|
| PSI 20 | 5.261,96 | -0,61% | -2,35% | 5.801,45 | 5.014,62 |
| CAC40 | 5.243,84 | -0,31% | -1,29% | 5.657,44 | 5.038,12 |
| ESTX 50 PR | 3.295,95 | -0,59% | -5,94% | 3.708,82 | 3.261,86 |
| XTRA DAX | 11.955,25 | -0,71% | -7,45% | 13.596,89 | 11.726,62 |
| S&P 500 | 2.874,78 | -0,48% | 7,52% | 2.916,50 | 2.459,20 |
| IBEX 35 | 9.208,70 | -1,00% | -8,32% | 10.643,40 | 9.208,60 |
| NIKKEI 225 | 22.487,94 | -0,41% | -1,22% | 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.