

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

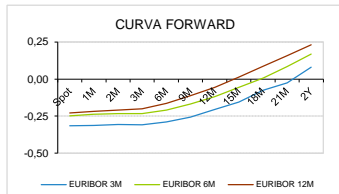
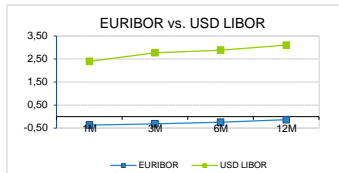
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

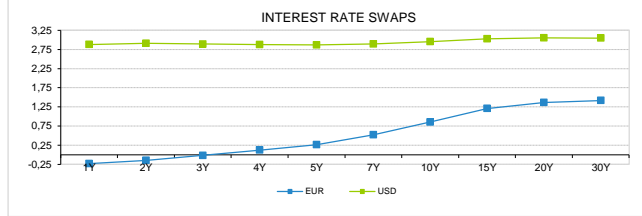
| INTERBANK OFFERED RATES | | | | | | | | | |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M | -0,3680 | 0 | 0 | 1M | 2,4002 | 1 | 8 | 0,7360 | -0,8378 |
| 3M | -0,3140 | 0 | 0 | 3M | 2,7711 | 0 | 17 | 0,9065 | -0,7390 |
| 6M | -0,2450 | 0 | 1 | 6M | 2,8858 | 0 | 4 | 1,0295 | -0,6638 |
| 12M | -0,1340 | 0 | 1 | 12M | 3,1006 | -1 | -2 | 1,1576 | -0,5260 |

| INTEREST RATE SWAPS | | | | | | |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|--------|--------|
| EUR | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y | 3Y | 5Y |
| 1Y | -0,2282 | 0 | 1 | -0,0565 | 0,5415 | 1,0830 |
| 2Y | -0,1430 | 0 | -2 | 0,0869 | 0,6830 | 1,1937 |
| 3Y | -0,0160 | 0 | -5 | 0,2377 | 0,8150 | 1,2995 |
| 4Y | 0,1250 | 0 | -8 | 0,3835 | 0,9366 | 1,3919 |
| 5Y | 0,2640 | 0 | -10 | 0,5207 | 1,0494 | 1,4750 |
| 7Y | 0,5250 | 1 | -11 | 0,7694 | 1,2423 | 1,6020 |
| 10Y | 0,8570 | 1 | -11 | 1,0649 | 1,4381 | 1,7151 |
| 15Y | 1,2100 | 1 | -11 | 1,3386 | 1,5877 | 1,7650 |
| 20Y | 1,3650 | 1 | -10 | 1,4489 | 1,6206 | 1,7290 |
| 30Y | 1,4190 | 1 | -10 | 1,4617 | 1,5728 | 1,6390 |

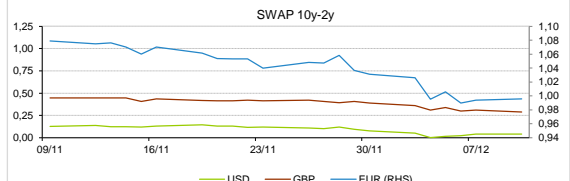
| TAXA DE REFERENCIA | |
|--------------------|-------|
| BANCO CENTRAL | |
| Zona Euro | 0,00 |
| EUA | 2,25 |
| Reino Unido | 0,75 |
| Japão | 0,10 |
| Canadá | 1,75 |
| Suíça | -0,75 |
| China | 5,75 |
| Brasil | 6,50 |
| Austrália | 1,50 |
| Índia | 4,00 |



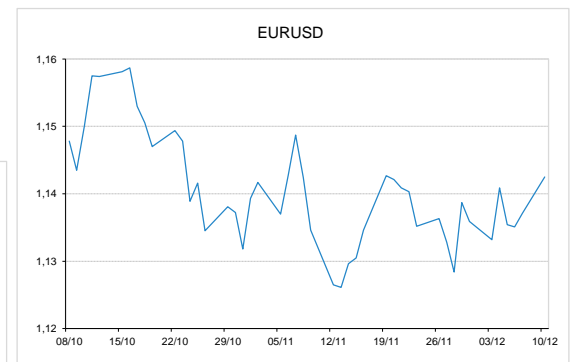
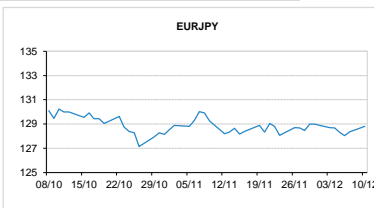
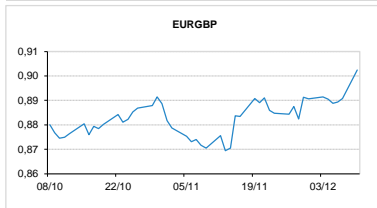
| INTEREST RATE SWAPS | | | | FORWARDS | | |
|---------------------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|
| USD | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y | 3Y | 5Y |
| 1Y | 2,8790 | 3 | -7 | 2,8759 | 2,6940 | 2,8450 |
| 2Y | 2,9110 | 4 | -21 | 2,7860 | 2,7605 | 2,8470 |
| 3Y | 2,8910 | 4 | -27 | 2,7773 | 2,7870 | 2,8950 |
| 4Y | 2,8760 | 5 | -30 | 2,7809 | 2,8110 | 2,9532 |
| 5Y | 2,8700 | 5 | -31 | 2,7810 | 2,8400 | 2,9862 |
| 7Y | 2,8930 | 5 | -31 | 2,8170 | 2,8835 | 3,0040 |
| 10Y | 2,9540 | 6 | -30 | 2,8920 | 2,9600 | 3,0330 |
| 15Y | 3,0300 | 6 | -28 | 2,9370 | 2,9960 | 3,0380 |
| 20Y | 3,0540 | 6 | -27 | 2,9690 | 3,0159 | 3,0200 |
| 30Y | 3,0470 | 5 | -25 | 2,9560 | 2,9650 | 2,9740 |



| COMMODITIES | LAST | Var. 1D | Var. 1M | BONDS | YIELD | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT | 60,82 | -0,85 | -9,57 | OT 2Y | -0,255 | -0,02 | -10,00 |
| JETFUEL | 608,05 | -17,91 | -93,51 | OT 5Y | 0,541 | -0,02 | -20,00 |
| DIESEL | 566,30 | -18,41 | -94,76 | OT 10Y | 1,785 | -0,01 | -15,50 |
| COBRE | 6.149,00 | 75,00 | -8,00 | BUND 10Y | -0,242 | -0,66 | -23,40 |
| ZINCO | 2.649,00 | -8,00 | 179,50 | SCHATZ 2Y | 0,073 | 2,53 | -3,50 |
| OURO | 1.244,85 | -1,83 | 36,53 | T-NOTE 10Y | 3,525 | 0,17 | -34,20 |
| TRIGO | 525,75 | -5,50 | 13,50 | T-NOTE 2Y | 3,016 | -1,17 | -34,60 |
| LICENÇA C02 | 20,86 | 0,57 | 1,36 | GILT 10Y | 1,422 | -5,63 | -34,80 |


CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M | FW 6M | FW 12M |
|---------|---------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,1425 | 0,47% | 1,42% | 1,1518 | 1,1610 | 1,1798 |
| EUR/GBP | 0,90245 | -1,29% | -2,97% | 0,9055 | 0,9087 | 0,9155 |
| EUR/JPY | 128,79 | -0,33% | -0,46% | 128,79 | 128,79 | 128,79 |
| EUR/CHF | 1,1247 | 0,34% | 0,87% | 1,1235 | 1,1224 | 1,1200 |
| EUR/BRL | 4,4816 | -0,46% | -5,60% | 4,5434 | 4,6137 | 4,7634 |
| EUR/PLN | 4,2961 | -0,11% | 0,09% | 4,3196 | 4,3435 | 4,3917 |

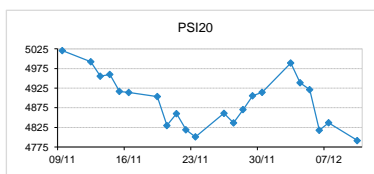

FIXINGS CONTRA USD e EUR

| | EUR | USD | GBP | JPY | CHF | SEK | DKK | CAD | AUD | BRL | NOK |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|
| EUR | - | 1,1425 | 0,9025 | 128,79 | 1,1247 | 10,3236 | 7,4640 | 1,5239 | 1,58302 | 4,4816 | 9,7239 |
| USD | 0,8786 | - | 0,7976 | 113,005 | 0,9890 | 9,0745 | 6,5580 | 1,3390 | 1,3912 | 3,9333 | 8,5316 |

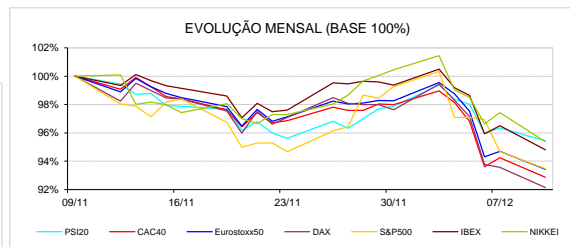
ACCIONISTA

| TITULO | COTACAO | 1D % | YTD % |
|--------------|---------|-------|--------|
| ALTRI | 5,680 | -4,22 | 9,84 |
| BCP | 0,241 | 0,71 | -11,51 |
| CORT. AMORIM | 9,220 | -2,12 | -10,49 |
| CTT | 3,308 | -0,96 | -5,67 |
| EDP | 3,056 | -1,20 | 5,93 |
| EDP R | 7,630 | -0,52 | 9,52 |
| GALP | 14,295 | -1,55 | -6,72 |
| IBERSOL | 8,260 | 1,47 | -18,42 |
| J MARTINS | 10,580 | 0,81 | -34,67 |
| MOTA ENGL | 1,546 | -3,86 | -57,79 |
| NAVIGATOR | 3,536 | -2,10 | -16,21 |
| NOS | 5,250 | -1,04 | -4,21 |
| NOVABASE | 2,350 | 0,00 | -22,93 |
| PHAROL | 0,180 | 0,78 | -28,08 |
| REN | 2,392 | -0,50 | -3,51 |
| SEMAPA | 12,920 | -5,00 | -27,40 |
| SONAE CAP. | 0,870 | 2,59 | -1,92 |
| SONAE SGPS | 0,819 | -1,39 | -27,31 |

| MAIORES GANHOS/PERDAS | |
|-----------------------|------------|
| Título | Variação % |
| SONAE CAP. | 2,59 |
| IBERSOL | 1,47 |
| J MARTINS | 0,81 |
| PHAROL | 0,78 |
| BCP | 0,71 |
| NAVIGATOR | -2,10 |
| CORT. AMORIM | -2,12 |
| MOTA ENGL | -3,86 |
| ALTRI | -4,22 |
| SEMAPA | -5,00 |



| INDICE | LAST | Var. 1D | YTD% | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|---------|-----------|-----------|
| PSI 20 | 4.791,29 | -0,94% | -11,08% | 5.801,45 | 4.782,65 |
| CAC40 | 4.742,38 | -1,47% | -10,73% | 5.657,44 | 4.732,02 |
| ESTX 50 PR | 3.016,99 | -1,36% | -13,90% | 3.687,22 | 3.007,53 |
| XTRA DAX | 10.622,07 | -1,54% | -17,77% | 13.596,89 | 10.585,77 |
| S&P 500 | 2.598,07 | -1,26% | -2,76% | 2.940,91 | 2.532,69 |
| IBEX 35 | 8.660,00 | -1,76% | -13,78% | 10.643,40 | 8.627,60 |
| NIKKEI 225 | 21.219,50 | -2,12% | -6,79% | 24.448,07 | 20.347,49 |



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.