

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

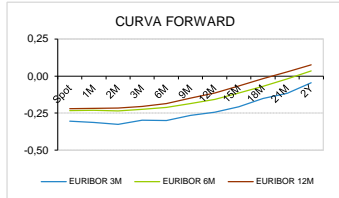
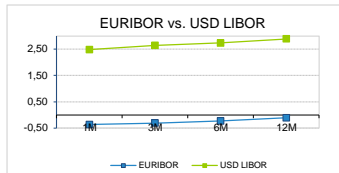
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

**RENDA FIXA**

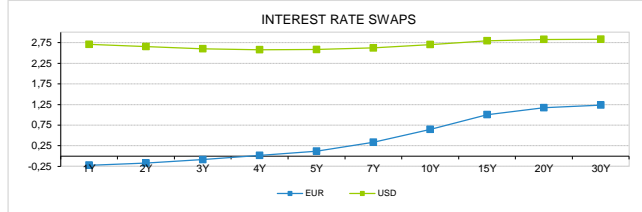
| INTERBANK OFFERED RATES |         |          |          |           |            |          |          |           |           |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M                      | -0,3670 | 0        | 0        | 1M        | 2,4823     | 0        | -2       | 0,7285    | -0,7776   |
| 3M                      | -0,3080 | 0        | 0        | 3M        | 2,6413     | 0        | -12      | 0,8664    | -0,7194   |
| 6M                      | -0,2310 | 0        | 0        | 6M        | 2,7358     | -2       | -12      | 0,9925    | -0,6556   |
| 12M                     | -0,1080 | 0        | 1        | 12M       | 2,8911     | -2       | -14      | 1,1244    | -0,5150   |

| INTEREST RATE SWAPS |         |          |          |         |        |        |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|--------|--------|
| EUR                 | FIXING  | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y      | 3Y     | 5Y     |
| 1Y                  | -0,2214 | 0        | 0        | -0,1149 | 0,3019 | 0,7591 |
| 2Y                  | -0,1690 | -1       | -2       | -0,0186 | 0,4138 | 0,8640 |
| 3Y                  | -0,0860 | -1       | -4       | 0,0884  | 0,5285 | 0,9730 |
| 4Y                  | 0,0150  | -1       | -6       | 0,1982  | 0,6374 | 1,0756 |
| 5Y                  | 0,1200  | -1       | -9       | 0,3079  | 0,7460 | 1,1688 |
| 7Y                  | 0,3360  | -1       | -13      | 0,5260  | 0,9450 | 1,3164 |
| 10Y                 | 0,6450  | -1       | -17      | 0,8170  | 1,1636 | 1,4561 |
| 15Y                 | 1,0040  | -1       | -18      | 1,1103  | 1,3463 | 1,5410 |
| 20Y                 | 1,1700  | 0        | -17      | 1,2410  | 1,4035 | 1,5267 |
| 30Y                 | 1,2370  | 0        | -17      | 1,2769  | 1,3760 | 1,4486 |

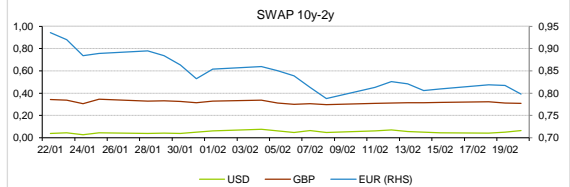
| TAXA DE REFERENCIA |       |
|--------------------|-------|
| BANCO CENTRAL      |       |
| Zona Euro          | 0,00  |
| EUA                | 2,50  |
| Reino Unido        | 0,75  |
| Japão              | 0,10  |
| Canadá             | 1,75  |
| Suíça              | -0,75 |
| China              |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



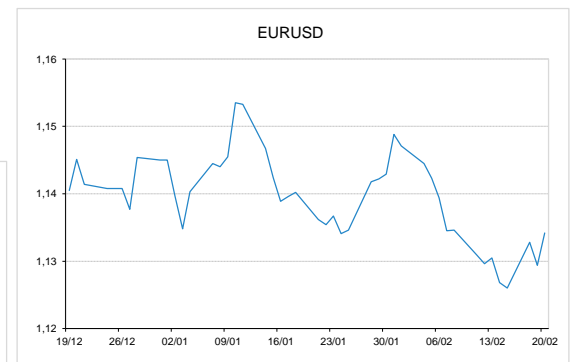
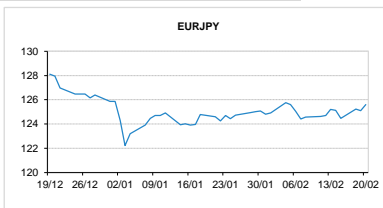
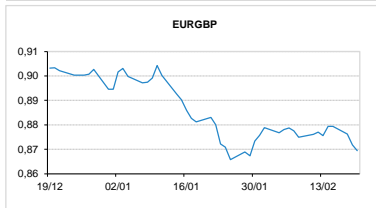
| INTEREST RATE SWAPS |        |          |          | FORWARDS |        |        |
|---------------------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|
| USD                 | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y       | 3Y     | 5Y     |
| 1Y                  | 2,7070 | 0        | -5       | 2,5584   | 2,4490 | 2,6205 |
| 2Y                  | 2,6530 | 2        | -4       | 2,4996   | 2,4920 | 2,6996 |
| 3Y                  | 2,6000 | 2        | -4       | 2,4918   | 2,5611 | 2,7030 |
| 4Y                  | 2,5790 | 2        | -4       | 2,5072   | 2,6039 | 2,7799 |
| 5Y                  | 2,5830 | 2        | -3       | 2,5363   | 2,6065 | 2,8198 |
| 7Y                  | 2,6210 | 2        | -4       | 2,5640   | 2,6910 | 2,8320 |
| 10Y                 | 2,7020 | 2        | -4       | 2,6800   | 2,8060 | 2,8620 |
| 15Y                 | 2,7960 | 1        | -4       | 2,7908   | 2,8360 | 2,9269 |
| 20Y                 | 2,8280 | 1        | -4       | 2,8215   | 2,8270 | 2,9118 |
| 30Y                 | 2,8310 | 1        | -4       | 2,8227   | 2,7980 | 2,8240 |



| COMMODITIES | LAST     | Var. 1D | Var. 1M | BONDS      | YIELD  | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT       | 67,32    | 0,87    | 4,73    | OT 2Y      | -0,233 | 0,00     | -8,10    |
| JETFUEL     | 652,50   | 5,75    | 36,00   | OT 5Y      | 0,352  | 0,00     | -20,90   |
| DIESEL      | 621,50   | 6,25    | 43,75   | OT 10Y     | 1,519  | 0,01     | -23,20   |
| COBRE       | 6.332,00 | 44,00   | 267,00  | BUND 10Y   | -0,478 | -0,65    | -17,20   |
| ZINCO       | 2.679,50 | 21,00   | 88,50   | SCHATZ 2Y  | 0,053  | -0,23    | 0,90     |
| OURO        | 1.344,66 | 4,02    | 61,98   | T-NOTE 10Y | 3,367  | 0,16     | -10,80   |
| TRIGO       | 485,00   | -7,25   | -38,50  | T-NOTE 2Y  | 2,864  | -0,19    | -8,70    |
| LICENÇA C02 | 20,47    | 0,26    | -4,39   | GILT 10Y   | 1,422  | 0,48     | -12,20   |


**CAMBIAL**

| CAMBIAL | FIXING  | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M  | FW 6M  | FW 12M |
|---------|---------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,1342  | 0,43%   | -0,18%  | 1,1427 | 1,1517 | 1,1701 |
| EUR/GBP | 0,86945 | 0,28%   | 1,56%   | 0,8721 | 0,8750 | 0,8814 |
| EUR/JPY | 125,61  | -0,41%  | -0,80%  | 125,61 | 125,61 | 125,61 |
| EUR/CHF | 1,1355  | 0,00%   | -0,13%  | 1,1344 | 1,1333 | 1,1309 |
| EUR/BRL | 4,2201  | 0,05%   | 1,33%   | 4,2792 | 4,3450 | 4,4752 |
| EUR/PLN | 4,3329  | -0,04%  | -1,16%  | 4,3536 | 4,3756 | 4,4206 |

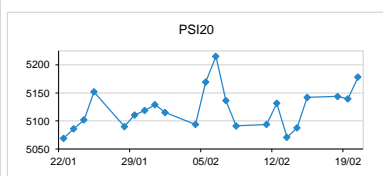

**FIXINGS CONTRA USD e EUR**

|     | EUR    | USD    | GBP    | JPY     | CHF    | SEK     | DKK    | CAD    | AUD     | BRL    | NOK    |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|
| EUR | -      | 1,1342 | 0,8695 | 125,61  | 1,1355 | 10,5745 | 7,4618 | 1,4964 | 1,58418 | 4,2201 | 9,7469 |
| USD | 0,8812 | -      | 0,7657 | 110,775 | 0,9997 | 9,3158  | 6,5751 | 1,3172 | 1,3956  | 3,7155 | 8,5940 |

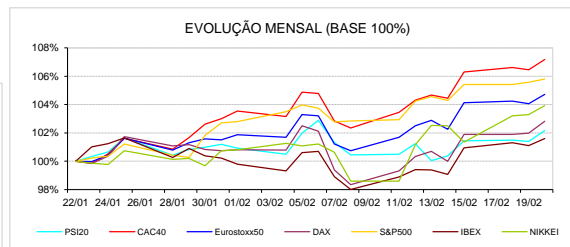
**ACCIONISTA**

| TITULO       | COTACÃO | 1D %  | YTD % |
|--------------|---------|-------|-------|
| ALTRI        | 7,300   | 1,25  | 25,86 |
| BCP          | 0,234   | 1,43  | 2,09  |
| CORT. AMORIM | 9,480   | -1,15 | 5,33  |
| CTT          | 3,132   | 1,95  | 6,31  |
| EDP          | 3,273   | 0,09  | 7,35  |
| EDP R        | 8,155   | 0,12  | 4,89  |
| GALP         | 14,635  | 1,56  | 6,09  |
| IBERSOL      | 8,020   | -1,23 | 1,52  |
| J MARTINS    | 12,645  | 0,84  | 22,29 |
| MOTA ENGIL   | 1,960   | 1,45  | 21,74 |
| NAVIGATOR    | 4,418   | 2,22  | 22,72 |
| NOS          | 5,350   | 0,19  | 1,04  |
| NOVABASE     | 2,440   | -1,21 | 20,79 |
| PHAROL       | 0,181   | 0,22  | 10,91 |
| REN          | 2,592   | 0,15  | 6,49  |
| SEMAPA       | 15,760  | 0,77  | 20,31 |
| SONAE CAP.   | 0,891   | 0,11  | 4,95  |
| SONAE SGPS   | 0,913   | -0,16 | 12,72 |
| -            | -       | -     | -     |
| -            | -       | -     | -     |
| -            | -       | -     | -     |

| MAIORES GANHOS/PERDAS |           |
|-----------------------|-----------|
| Título                | Varição % |
| NAVIGATOR             | 2,22      |
| CTT                   | 1,95      |
| GALP                  | 1,56      |
| MOTA ENGIL            | 1,45      |
| BCP                   | 1,43      |
| SONAE SGPS            | -0,16     |
| CORT. AMORIM          | -1,15     |
| NOVABASE              | -1,21     |
| IBERSOL               | -1,23     |



| ÍNDICE     | LAST      | Var. 1D | YTD%   | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|--------|-----------|-----------|
| PSI 20     | 5.178,20  | 0,76%   | 9,44%  | 5.801,45  | 4.551,84  |
| CAC40      | 5.195,95  | 0,69%   | 9,83%  | 5.657,44  | 4.555,99  |
| ESTX 50 PR | 3.259,49  | 0,62%   | 8,60%  | 3.596,20  | 2.908,70  |
| XTRA DAX   | 11.401,97 | 0,82%   | 7,98%  | 13.204,31 | 10.279,20 |
| S&P 500    | 2.785,46  | 0,21%   | 11,12% | 2.940,91  | 2.346,58  |
| IBEX 35    | 9.181,10  | 0,49%   | 7,51%  | 10.291,40 | 8.286,20  |
| NIKKEI 225 | 21.431,49 | 0,60%   | 7,08%  | 24.448,07 | 18.948,58 |



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.