

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

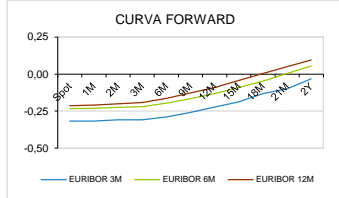
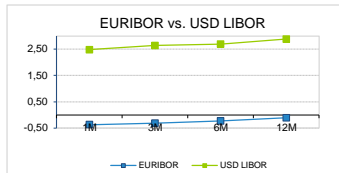
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

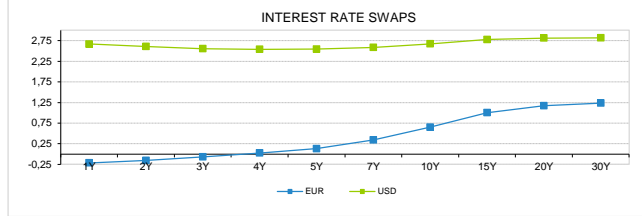
| INTERBANK OFFERED RATES | | | | | | | | | |
|-------------------------|---------|----------|----------|-----------|------------|----------|----------|-----------|-----------|
| EURIBOR | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | USD LIBOR | LAST PRICE | 1D (bps) | 1M (bps) | GBP LIBOR | CHF LIBOR |
| 1M | -0,3680 | 0 | 0 | 1M | 2,4791 | -1 | -2 | 0,7290 | -0,7786 |
| 3M | -0,3100 | 0 | 0 | 3M | 2,6386 | -1 | -11 | 0,8598 | -0,7178 |
| 6M | -0,2300 | 0 | 1 | 6M | 2,6931 | -1 | -14 | 0,9951 | -0,6512 |
| 12M | -0,1080 | 0 | 1 | 12M | 2,8831 | -1 | -15 | 1,1365 | -0,5112 |

| INTEREST RATE SWAPS | | | | | | |
|---------------------|---------|----------|----------|---------|--------|--------|
| EUR | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y | 3Y | 5Y |
| 1Y | -0,2137 | 0 | 1 | -0,0912 | 0,3083 | 0,7648 |
| 2Y | -0,1540 | 0 | 1 | 0,0030 | 0,4179 | 0,8820 |
| 3Y | -0,0690 | 0 | 0 | 0,1044 | 0,5320 | 0,9908 |
| 4Y | 0,0270 | 0 | -2 | 0,2094 | 0,6480 | 1,0939 |
| 5Y | 0,1300 | 0 | -3 | 0,3183 | 0,7586 | 1,1830 |
| 7Y | 0,3440 | 0 | -6 | 0,5392 | 0,9610 | 1,3310 |
| 10Y | 0,6490 | 0 | -7 | 0,8312 | 1,1814 | 1,4730 |
| 15Y | 1,0040 | 0 | -7 | 1,1287 | 1,3668 | 1,5590 |
| 20Y | 1,1700 | 0 | -6 | 1,2616 | 1,4250 | 1,5470 |
| 30Y | 1,2370 | 0 | -5 | 1,2966 | 1,3969 | 1,4690 |

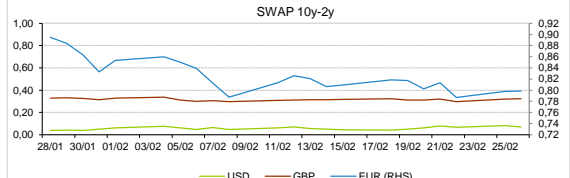
| TAXA DE REFERENCIA | |
|--------------------|-------|
| BANCO CENTRAL | |
| Zona Euro | 0,00 |
| EUA | 2,50 |
| Reino Unido | 0,75 |
| Japão | 0,10 |
| Canadá | 1,75 |
| Suíça | -0,75 |
| China | 5,75 |
| Brasil | 6,50 |
| Austrália | 1,50 |
| Índia | 4,00 |



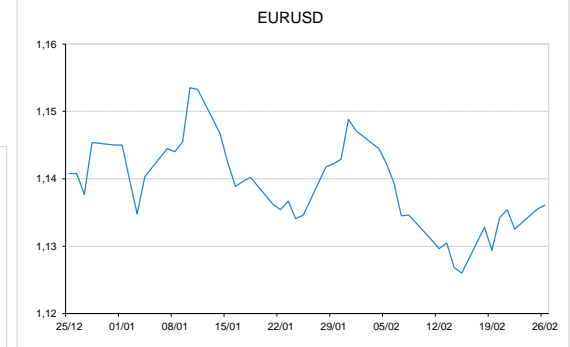
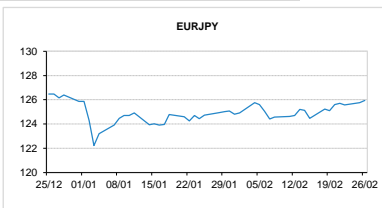
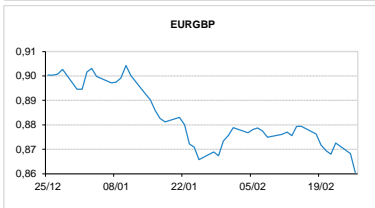
| INTEREST RATE SWAPS | | | | FORWARDS | | |
|---------------------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|
| USD | FIXING | 1D (bps) | 1M (bps) | 1Y | 3Y | 5Y |
| 1Y | 2,6660 | -1 | -12 | 2,5115 | 2,4482 | 2,6130 |
| 2Y | 2,6070 | -2 | -14 | 2,4583 | 2,4715 | 2,6630 |
| 3Y | 2,5550 | -3 | -14 | 2,4320 | 2,5200 | 2,7090 |
| 4Y | 2,5380 | -3 | -13 | 2,4540 | 2,5650 | 2,7490 |
| 5Y | 2,5420 | -3 | -13 | 2,4850 | 2,6110 | 2,8067 |
| 7Y | 2,5850 | -3 | -13 | 2,5580 | 2,6910 | 2,8460 |
| 10Y | 2,6720 | -3 | -11 | 2,6620 | 2,7780 | 2,8860 |
| 15Y | 2,7750 | -3 | -10 | 2,7590 | 2,8320 | 2,9000 |
| 20Y | 2,8120 | -3 | -9 | 2,7900 | 2,8601 | 2,9109 |
| 30Y | 2,8180 | -3 | -8 | 2,8111 | 2,8423 | 2,8460 |



| COMMODITIES | LAST | Var. 1D | Var. 1M | BONDS | YIELD | 1D (bps) | 1M (bps) |
|-------------|----------|---------|---------|------------|--------|----------|----------|
| BRENT | 65,31 | 0,55 | 3,72 | OT 2Y | -0,252 | -0,01 | -7,10 |
| JETFUEL | 639,75 | -15,33 | 31,84 | OT 5Y | 0,271 | -0,03 | -21,20 |
| DIESEL | 612,00 | -14,83 | 39,34 | OT 10Y | 1,432 | -0,03 | -21,70 |
| COBRE | 6.485,50 | 2,00 | 424,00 | BUND 10Y | -0,463 | 0,72 | -8,90 |
| ZINCO | 2.740,25 | -5,25 | 49,75 | SCHATZ 2Y | 0,069 | 0,69 | 2,50 |
| OURO | 1.327,08 | 0,73 | 29,36 | T-NOTE 10Y | 3,362 | -2,30 | -8,90 |
| TRIGO | 467,75 | -5,00 | -59,25 | T-NOTE 2Y | 2,864 | -1,56 | -7,40 |
| LICENÇA C02 | 19,61 | 0,37 | -4,32 | GILT 10Y | 1,426 | 1,62 | -10,70 |


CAMBIAL

| CAMBIAL | FIXING | Var. 1D | Var. 1M | FW 3M | FW 6M | FW 12M |
|---------|---------|---------|---------|--------|--------|--------|
| EUR/USD | 1,1361 | 0,05% | -0,50% | 1,1449 | 1,1537 | 1,1716 |
| EUR/GBP | 0,86055 | 0,90% | 0,97% | 0,8632 | 0,8660 | 0,8721 |
| EUR/JPY | 125,93 | -0,14% | -0,79% | 125,93 | 125,93 | 125,93 |
| EUR/CHF | 1,1379 | -0,19% | -0,41% | 1,1368 | 1,1357 | 1,1333 |
| EUR/BRL | 4,2785 | -0,47% | 0,61% | 4,3403 | 4,4069 | 4,5389 |
| EUR/PLN | 4,3241 | 0,30% | -0,71% | 4,3452 | 4,3667 | 4,4103 |

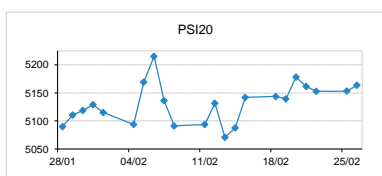

FIXINGS CONTRA USD e EUR

| | EUR | USD | GBP | JPY | CHF | SEK | DKK | CAD | AUD | BRL | NOK |
|-----|--------|--------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|
| EUR | - | 1,1361 | 0,8606 | 125,93 | 1,1379 | 10,5825 | 7,4614 | 1,4997 | 1,58481 | 4,2785 | 9,7614 |
| USD | 0,8806 | - | 0,7557 | 110,745 | 1,0008 | 9,3165 | 6,5703 | 1,3198 | 1,3942 | 3,7611 | 8,6009 |

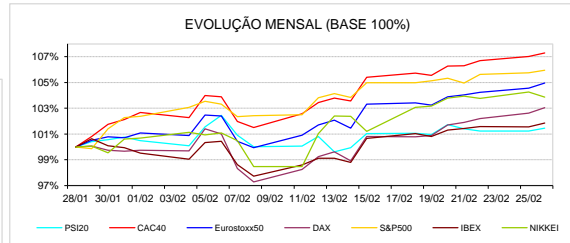
ACCIONISTA

| TITULO | COTACÃO | 1D % | YTD % |
|--------------|---------|-------|-------|
| ALTRI | 7,210 | 0,98 | 24,31 |
| BCP | 0,233 | 0,09 | 1,70 |
| CORT. AMORIM | 9,440 | 0,75 | 4,89 |
| CTT | 2,784 | 0,07 | -5,50 |
| EDP | 3,174 | -0,81 | 4,10 |
| EDP R | 8,275 | 0,00 | 6,43 |
| GALP | 14,710 | 0,82 | 6,63 |
| IBERSOL | 7,940 | 0,25 | 0,51 |
| J MARTINS | 13,120 | 0,19 | 26,89 |
| MOTA ENGIL | 2,025 | 0,00 | 25,78 |
| NAVIGATOR | 4,410 | 0,59 | 22,50 |
| NOS | 5,310 | -0,56 | 0,28 |
| NOVABASE | 2,460 | 0,41 | 21,78 |
| PHAROL | 0,186 | 0,11 | 13,85 |
| REN | 2,600 | 0,00 | 6,82 |
| SEMAPA | 15,380 | 0,13 | 17,40 |
| SONAE CAP. | 0,869 | 1,76 | 2,36 |
| SONAE SGPS | 0,925 | 2,10 | 14,20 |

| MAIORES GANHOS/PERDAS | |
|-----------------------|------------|
| Título | Variação % |
| SONAE SGPS | 2,10 |
| SONAE CAP. | 1,76 |
| ALTRI | 0,98 |
| GALP | 0,82 |
| CORT. AMORIM | 0,75 |
| NOS | -0,56 |
| EDP | -0,81 |



| ÍNDICE | LAST | Var. 1D | YTD% | MAX Anual | MIN Anual |
|------------|-----------|---------|--------|-----------|-----------|
| PSI 20 | 5.163,63 | 0,20% | 9,13% | 5.801,45 | 4.551,84 |
| CAC40 | 5.245,79 | 0,27% | 10,89% | 5.657,44 | 4.555,99 |
| ESTX 50 PR | 3.292,65 | 0,39% | 9,70% | 3.596,20 | 2.908,70 |
| XTRA DAX | 11.550,65 | 0,39% | 9,39% | 13.204,31 | 10.279,20 |
| S&P 500 | 2.800,53 | 0,17% | 11,73% | 2.940,91 | 2.346,58 |
| IBEX 35 | 9.229,40 | 0,27% | 8,07% | 10.291,40 | 8.286,20 |
| NIKKEI 225 | 21.449,39 | -0,37% | 7,17% | 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.