

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

Valor da Unidade de Participação: 5,92535
Nº de Unidades de Participação: 8 332 148,22957

DESIGNAÇÃO	QUANTIDADE	MOEDA	COTAÇÃO/ PREÇO UNIT. (EM EUROS)	VALOR	JUROS DECORRIDOS (EM EUROS)	MONTANTE GLOBAL (EM EUROS)
VALORES MOBILIÁRIOS COTADOS	44 577 032			46 189 449,82	96 872,49	46 286 322,31
Mercado de cotações oficiais de bolsa de valores portuguesa e outros mercados regulamentados	4 828 500			4 836 575,09	19 757,23	4 856 332,32
Títulos de dívida pública	4 828 500			4 836 575,09	19 757,23	4 856 332,32
AZORES 1.006% 15/06/29	400 000	EUR	103,32	413 296,00	165,37	413 461,37
AZORES 1.85% 21/08/25	312 500	EUR	103,85	324 529,69	5 026,47	329 556,16
PGB 0.475% 18/10/30	2 724 000	EUR	101,97	2 777 553,84	9 039,57	2 786 593,41
PGB 1% 12/04/52	1 017 000	EUR	91,27	928 195,56	3 900,82	932 096,38
PGB Float 23/07/25	375 000	EUR	104,8	393 000,00	1 625,00	394 625,00
Mercado de cotações oficiais de bolsa valores de outros Estados-membro da União Europeia	38 848 532			40 450 080,73	76 675,20	40 526 755,93
Títulos de dívida pública	24 017 000			24 496 694,63	53 511,69	24 550 206,32
BTPTS 0.9% 01/04/31	2 753 000	EUR	101,16	2 784 934,80	6 109,40	2 791 044,20
BTPTS 1.5% 30/04/45	555 000	EUR	97,25	539 748,60	1 387,50	541 136,10
CCTS Float 15/01/25	500 000	EUR	105,42	527 100,00	3 050,25	530 150,25
CCTS Float 15/12/23	2 500 000	EUR	100,76	2 519 000,00	30,21	2 519 030,21
DBR 0% 15/02/31	9 141 000	EUR	102,46	9 365 868,60	0,00	9 365 868,60
FRTR 0.5% 25/06/44	564 000	EUR	95,49	538 535,40	38,63	538 574,03
PGB Float 02/08/22	761 000	EUR	102,1	776 981,00	3 344,43	780 325,43
PGB Float 12/04/22	215 000	EUR	101,7	218 655,00	652,04	219 307,04
PGB Float 12/08/21	436 000	EUR	100,15	436 654,00	3 426,23	440 080,23
PGB Floater 05/12/22	412 000	EUR	101,7	418 983,40	314,72	419 298,12
ROMANI 2% 14/04/33	3 260 000	EUR	99,23	3 234 767,60	13 754,52	3 248 522,12
SPGB 0.4% 30/04/22	367 000	EUR	100,81	369 980,04	245,34	370 225,38
SPGB 1.25% 31/10/30	2 553 000	EUR	108,32	2 765 486,19	21 158,42	2 786 644,61
Obrigações diversas	14 760 000			14 836 107,80	23 163,51	14 859 271,31
BACR 0.75% 09/06/25-24	100 000	EUR	101,69	101 686,00	43,15	101 729,15
BACRED Float 18/05/22	500 000	EUR	100,46	502 290,00	147,51	502 437,51
BAYNGR Float 26/06/22	400 000	EUR	100,29	401 176,00	0,53	401 176,53
BKIASM 0.75% 09/07/26	500 000	EUR	102,38	511 910,00	3 657,53	515 567,53
BMW Float 24/06/22	500 000	EUR	100,45	502 260,00	5,00	502 265,00
BNFP 0% 01/12/25	200 000	EUR	100,41	200 812,00	0,00	200 812,00
CONGR 0% 12/09/23	250 000	EUR	100,12	250 300,00	0,00	250 300,00
CS Float 20/12/22	300 000	EUR	101,55	304 656,00	82,25	304 738,25
DE Float 03/10/22	200 000	EUR	100,46	200 920,00	0,00	200 920,00
DT Float 01/12/22	350 000	EUR	100,52	351 823,50	0,00	351 823,50
ERFFP 2.125% 25/07/24	200 000	EUR	105,8	211 600,00	3 958,90	215 558,90
FCABNK 0% 16/04/24	470 000	EUR	99,94	469 727,40	0,00	469 727,40
GS Float 21/04/23-22	240 000	EUR	100,18	240 439,20	6,07	240 445,27
GS Float 26/09/23-22	300 000	EUR	100,26	300 789,00	2,73	300 791,73
HAR 2% 27/05/22	500 000	EUR	101,46	507 290,00	931,51	508 221,51
ISPIM Float 14/10/22	200 000	EUR	100,47	200 940,00	69,30	201 009,30
LGCHM 0.5% 15/04/23	100 000	EUR	100,83	100 830,00	104,11	100 934,11
LSELN 0% 06/04/25	600 000	EUR	99,97	599 790,00	0,00	599 790,00
Lloyds Float 21/06/24	250 000	EUR	101,3	253 240,00	14,81	253 254,81
MAN 1.875% 11/09/22	400 000	EUR	101,85	407 416,00	6 000,00	413 416,00
MS Float 08/11/22	300 000	EUR	100,21	300 642,00	74,64	300 716,64
NDAQ 1.75% 19/05/23	300 000	EUR	103,06	309 186,00	604,11	309 790,11
NHYNO 1.125% 11/04/25	300 000	EUR	103,28	309 843,00	739,73	310 582,73
NOSPL 1.125% 02/05/23	600 000	EUR	101,53	609 162,00	1 091,10	610 253,10
PARPUB Float 22/10/27-22	350 000	EUR	96,62	338 173,50	0,00	338 173,50
PBBGR Float 28/07/23	600 000	EUR	100,97	605 832,00	380,10	606 212,10
PKOBP 0.75% 25/07/21	400 000	EUR	99,92	399 672,00	2 794,52	402 466,52
RBS Float 27/09/21	460 000	EUR	100,19	460 874,00	13,88	460 887,88
RENEPL 0.5% 16/04/29	650 000	EUR	99,97	649 805,00	667,81	650 472,81
REPSM 0.375% 06/07/29	500 000	EUR	99,55	497 740,00	0,00	497 740,00
RY 0.125% 23/07/24	100 000	EUR	100,78	100 781,00	117,12	100 898,12

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA [continuação]

DESIGNAÇÃO	QUANTIDADE	MOEDA	COTAÇÃO/ PREÇO UNIT. (EM EUROS)	VALOR	JUROS DECORRIDOS (EM EUROS)	MONTANTE GLOBAL (EM EUROS)
SCBNOR 0.125% 25/02/25	300 000	EUR	100,1	300 312,00	128,42	300 440,42
SEVFP 0% 09/06/26	600 000	EUR	99,68	598 056,00	0,00	598 056,00
SOCGEN 0.125% 18/02/28	900 000	EUR	98,80	889 155,00	406,85	889 561,85
SRGIM Float 02/08/24	500 000	EUR	100,37	501 865,00	0,00	501 865,00
UBS Float 20/09/22-21	200 000	EUR	100,12	200 232,00	8,72	200 240,72
UCGIM 0.325% 19/01/26	340 000	EUR	99,77	339 211,20	490,44	339 701,64
UCGIM 0.8% 05/07/29 - 28	300 000	EUR	100,2	300 603,00	0,00	300 603,00
VW Float 01/08/22	400 000	EUR	101,27	405 064,00	622,67	405 686,67
VW Float 06/07/21	100 000	EUR	100,0	100 004,00	0,00	100 004,00
Unidades de participação de fundos de investimento fechados	71 532			1117 278,30	0,00	1117 278,30
SPDR ETF-Blb Barclays 10+Y US Treasury Bond	20 209	EUR	28,22	570 277,77	0,00	570 277,77
UBS ETF-Blb Barclays US 10+Y Treasury Bond EUR	51 323	EUR	10,66	547 000,53	0,00	547 000,53
Mercado de cotações oficiais de bolsas de Estado não membro da União Europeia	900 000			902 794,00	440,06	903 234,06
Obrigações diversas	900 000			902 794,00	440,06	903 234,06
FDX 0.45% 04/05/29	500 000	EUR	99,59	497 970,00	351,37	498 321,37
T Float 05/09/23	400 000	EUR	101,21	404 824,00	88,69	404 912,69
UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO DE INSTITUIÇÕES DE INVESTIMENTO COLECTIVO	121 844			1 260 159,78	0,00	1 260 159,78
Fundos harmonizados	121 594			1 034 274,78	0,00	1 034 274,78
Amundi Funds - Absolute Forex	123	EUR	978,13	120 021,44	0,00	120 021,44
BNY Mellon Global Funds-Emerg Mkts Debt AE	116 769	EUR	2,08	242 763,42	0,00	242 763,42
Candriam Long Short Credit	69	EUR	1185,34	81 762,38	0,00	81 762,38
LM-WA Macro Opport BD	1139	EUR	131,57	149 895,73	0,00	149 895,73
Nordea 1 SICAV-Emerg Mkts Bond Fund	1 782	EUR	137,02	244 124,01	0,00	244 124,01
Nordea 1 SICAV-Flexible Fixed Income Fund	1 712	EUR	114,29	195 707,80	0,00	195 707,80
Fundos não harmonizados	250			225 885,00	0,00	225 885,00
Fundo Energia FCR - CAT B	250	EUR	903,54	225 885,00	0,00	225 885,00
IMOBILIÁRIO	11 423			212 353,57	0,00	212 353,57
Unidades de participação de fundos de investimento imobiliário	11 423			212 353,57	0,00	212 353,57
CA Património Crescente	11 423	EUR	18,59	212 353,57	0,00	212 353,57
LIQUIDEZ				1 612 067,80	0,00	1 612 067,80
À vista				2 617 568,16	0,00	2 617 568,16
Depósitos à ordem				2 617 568,16	0,00	2 617 568,16
EUR - CCCAM		EUR		1 680 043,73	0,00	1 680 043,73
EUR - FUTUROS - ALTURA		EUR		594 159,64	0,00	594 159,64
EUR - FUTUROS - CMG ALTURA		EUR		343 364,79	0,00	343 364,79
Devedores e Credores				-1 005 500,36	0,00	-1 005 500,36
Operações a Liquidar				-839 386,60	0,00	-839 386,60
Diferimento do Juro das OPLs		EUR		-0,74	0,00	-0,74
Liquidação Parcial Operações		EUR		-144 000,00	0,00	-144 000,00
OPL - Obrigações - Compra (Mercado Primário)		EUR		-795 244,00	0,00	-795 244,00
OPL - Obrigações - Venda (Fora de Bolsa) - Juro Bruto		EUR		99 858,14	0,00	99 858,14
Impostos				-6 425,31	0,00	-6 425,31
FP - IRS - Cat E		EUR		-38,02	0,00	-38,02
Imposto de Selo - FP - CD		EUR		-384,19	0,00	-384,19
Imposto do Selo - FP CG		EUR		-6 003,10	0,00	-6 003,10
Comissões				-159 688,45	0,00	-159 688,45
FP - Comissão de Depósito		EUR		-9 605,32	0,00	-9 605,32
FP - Comissão de Gestão		EUR		-150 083,13	0,00	-150 083,13
OPERAÇÕES COM PRODUTOS DERIVADOS	-113			0,00	0,00	0,00
Em mercado regulamentado	-113			0,00	0,00	0,00
Futuros	-113			0,00	0,00	0,00
Euro-BTP Future SET 21(FBTP-ALTURA)	-61	EUR	151,41	0,00	0,00	0,00
Euro-OAT Future SET 21 (FOAT-ALTURA)	-52	EUR	159,04	0,00	0,00	0,00
TOTAL				49 274 030,97	96 872,49	49 370 903,46