

31 de Dezembro de 2019

Valor da Unidade de Participação: 5,98684

Nº de Unidades de Participação: 5.942.809,13862

Composição da Carteira em 31 de Dezembro de 2019

	Designação	Quantidade	Moeda	Cotação/ Preço Unit. (em Euros)	VALOR	Juros Decorridos (em Euros)	Montante Global (em Euros)
1	VALORES MOBILIARIOS COTADOS	29.699.830		0,00	32.369.292,53	118.392,05	32.487.684,58
1.1	Mercado de cotações oficiais de bolsa de valores portuguesa e outros mercado	5.550.000		0,00	6.235.840,25	54.940,60	6.290.780,85
1.1.1	Títulos de dívida pública	5.550.000		0,00	6.235.840,25	54.940,60	6.290.780,85
1.1.1.1	AZORES 1.006% 15/06/29	400.000	EUR	100,99	403.968,00	1.770,12	405.738,12
1.1.1.1	AZORES 1.85% 21/08/25	375.000	EUR	104,47	391.762,50	2.543,75	394.306,25
1.1.1.1	PGB 1.95% 15/06/29	4.775.000	EUR	113,93	5.440.109,75	50.626,73	5.490.736,48
1.2	Mercado de cotações oficiais de bolsa valores de outros Estados-membro da Un	23.749.830		0,00	25.727.760,28	63.316,45	25.791.076,73
1.2.1	Títulos de dívida pública	7.344.000		0,00	7.519.573,94	29.700,44	7.549.274,38
1.2.1	BTPS 1.35% 01/04/30	3.433.000	EUR	99,46	3.414.461,80	11.523,06	3.425.984,86
1.2.1	DBR 0% 15/08/50	770.000	EUR	89,87	692.029,80	0,00	692.029,80
1.2.1	PGB Float 02/08/22	563.000	EUR	104,08	585.970,40	2.923,50	588.893,90
1.2.1	PGB Float 12/08/21	340.000	EUR	103,35	351.390,00	2.729,92	354.119,92
1.2.1	PGB Float 30/11/21	553.000	EUR	103,80	574.014,00	952,39	574.966,39
1.2.1	PGB Floater 05/12/22	221.000	EUR	103,09	227.828,90	175,57	228.004,47
1.2.1	SPGB 1.85% 30/07/35	1.464.000	EUR	114,34	1.673.879,04	11.396,00	1.685.275,04
1.2.3	Obrigações diversas	16.244.000		0,00	16.413.303,10	33.616,01	16.446.919,11
1.2.3	ACAFP 4.5% 29/09/21	550.000	EUR	107,71	592.405,00	135,25	592.540,25
1.2.3	AMSSM Float 18/03/22	400.000	EUR	100,20	400.804,00	7,80	400.811,80
1.2.3	BACR 0.75% 09/06/25-24	350.000	EUR	100,08	350.266,00	157,79	350.423,79
1.2.3	BACR Float 26/04/21	400.000	EUR	99,78	399.132,00	74,44	399.206,44
1.2.3	BACRED Float 18/05/22	500.000	EUR	100,32	501.600,00	237,10	501.837,10
1.2.3	BAYNGR Float 26/06/22	400.000	EUR	100,26	401.020,00	6,76	401.026,76
1.2.3	BBVASM 0.375% 15/11/26	400.000	EUR	99,22	396.884,00	188,52	397.072,52
1.2.3	BKIASM 0.75% 09/07/26	400.000	EUR	100,04	400.148,00	1.434,43	401.582,43
1.2.3	BNP 0.5% 04/06/26-25	200.000	EUR	100,24	200.472,00	73,77	200.545,77
1.2.3	BNS 0.125% 04/09/26	200.000	EUR	98,06	196.120,00	79,92	196.199,92
1.2.3	CCL 1.875% 11/07/22	800.000	EUR	105,36	842.864,00	2.213,11	845.077,11
1.2.3	CONGR 0% 12/09/23	250.000	EUR	99,13	247.835,00	0,00	247.835,00
1.2.3	CS Float 20/12/22	300.000	EUR	101,07	303.222,00	103,31	303.325,31
1.2.3	DAIGR 0.625% 27/02/23	400.000	EUR	101,33	405.320,00	2.102,74	407.422,74
1.2.3	De Float 03/10/22	200.000	EUR	100,05	200.106,00	0,00	200.106,00
1.2.3	DECFP Float 24/10/20	100.000	EUR	100,02	100.015,00	0,00	100.015,00
1.2.3	DT Float 01/12/22	350.000	EUR	100,26	350.913,50	0,00	350.913,50
1.2.3	EDPPL 0% 12/11/23	250.000	EUR	96,64	241.600,00	0,00	241.600,00
1.2.3	EOANGR 0% 29/09/22	400.000	EUR	99,76	399.044,00	0,00	399.044,00
1.2.3	FCABNK Float 16/04/21	400.000	EUR	99,79	399.162,00	282,04	399.444,04
1.2.3	GS Float 26/09/23-22	300.000	EUR	100,19	300.555,00	7,40	300.562,40
1.2.3	HAR 2% 27/05/22	350.000	EUR	104,04	364.126,00	4.161,64	368.287,64
1.2.3	HSBC Float 05/10/23-22	200.000	EUR	99,97	199.940,00	36,25	199.976,25
1.2.3	IAGLN 0.5% 04/07/23	500.000	EUR	99,78	498.880,00	1.229,51	500.109,51
1.2.3	INTNED 0.1% 03/09/25-24	400.000	EUR	98,47	393.892,00	130,05	394.022,05
1.2.3	ISPM 1% 19/11/26	300.000	EUR	99,66	298.977,00	344,26	299.321,26
1.2.3	ISPM Float 28/02/21	170.000	EUR	100,48	170.821,10	104,04	170.925,14
1.2.3	JEF 1% 19/07/24	200.000	EUR	100,39	200.772,00	901,64	201.673,64
1.2.3	LGCHM 0.5% 15/04/23	100.000	EUR	100,81	100.807,00	35,19	101.162,19
1.2.3	LHAGR 0.25% 06/09/24	300.000	EUR	99,62	298.851,00	237,70	299.088,70
1.2.3	Lloyds Float 21/06/24	250.000	EUR	100,79	251.962,50	26,53	251.989,03
1.2.3	MAN 1.875% 11/09/22	400.000	EUR	104,19	416.772,00	2.274,59	419.046,59
1.2.3	MS Float 08/11/22	300.000	EUR	100,51	301.518,00	129,85	301.647,85
1.2.3	NDAQ 1.75% 19/05/23	300.000	EUR	104,62	313.845,00	3.241,80	317.086,80
1.2.3	NDAQ 3.875% 07/06/21	100.000	EUR	105,54	105.543,00	2.191,60	107.734,60
1.2.3	NEXLN Float 15/05/20	300.000	EUR	99,97	299.895,00	0,00	299.895,00
1.2.3	NHYNO 1.125% 11/04/25	300.000	EUR	102,55	307.662,00	2.434,43	310.096,43
1.2.3	NOSPL 1.125% 02/05/23	200.000	EUR	101,98	203.966,00	1.493,85	205.459,85
1.2.3	PKOBP 0.75% 25/07/21	400.000	EUR	101,07	404.272,00	1.303,28	405.575,28
1.2.3	RABOBK Float 27/04/21	664.000	EUR	103,90	689.862,80	3.718,40	693.581,20
1.2.3	RBS Float 27/09/21	460.000	EUR	100,777	463.574,20	25,66	463.599,86
1.2.3	RENAUL 0.75% 10/04/23	200.000	EUR	100,559	201.118,00	1.086,07	202.204,07
1.2.3	RENAUL Float 12/01/23	200.000	EUR	98,5030	197.006,00	5,33	197.011,33
1.2.3	RY 0.125% 23/07/24	600.000	EUR	99,4000	596.400,00	329,92	596.729,92
1.2.3	SOCGEN Float 06/03/23	200.000	EUR	99,7710	199.542,00	7,92	199.549,92
1.2.3	SRGIM Float 02/08/24	200.000	EUR	98,795	197.590,00	1,97	197.591,97
1.2.3	UBS Float 20/09/22-21	200.000	EUR	100,559	201.118,00	18,15	201.136,15
1.2.3	UCGIM 2 30/06/23	400.000	EUR	99,190	396.476,00	3,36	396.479,36
1.2.3	VW Float 01/08/22	400.000	EUR	102,152	408.608,00	712,67	409.320,67
1.2.3	VW Float 06/07/21	100.000	EUR	100,019	100.019,00	5,97	100.024,97
1.2.5	Títulos de participação	1.490		0	152.039,60	0,00	152.039,60
1.2.5	Ishares JPM USD EM Bond UCITS ETF D	1.490	EUR	102,04	152.039,60	0,00	152.039,60
1.2.6	Unidades de participação de fundos de investimento fechados	160.340		0	1.642.843,64	0,00	1.642.843,64
1.2.6	UBS ETF-Bib Barclays US 10+Y Treasury Bond EUR	160.340	EUR	10,246	1.642.843,64	0,00	1.642.843,64
1.3	Mercado de cotações oficiais de bolsas de Estado não membro da União Europeia	400.000		0	405.692,00	135,00	405.827,00
1.3.3	Obrigações diversas	400.000		0	405.692,00	135,00	405.827,00
1.3.3	T Float 05/09/23	400.000	EUR	101,423	405.692,00	135,00	405.827,00
3	UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO DE INSTITUIÇÕES DE INVESTIMENTO COLECTIVO	81.109		0	1.330.117,05	0,00	1.330.117,05
3.1	Fundos harmonizados	80.859		0	1.092.142,05	0,00	1.092.142,05
3.1	Amundi Funds - Absolute Forex	123	EUR	1014,90999	124.534,53	0,00	124.534,53
3.1	BNY Mellon Global Funds-Emerg Mkts Debt AE	74.420	EUR	2,1429	159.473,61	0,00	159.473,61
3.1	Candriam Long Short Credit	69	EUR	1165,62005	80.402,14	0,00	80.402,14
3.1	LM-WA Macro Opport BD	1.139	EUR	128,75	146.682,94	0,00	146.682,94
3.1	Legg Mason AF - EnTrustPermal Alternative Inc Strategy	2.258	EUR	100,14	226.094,09	0,00	226.094,09
3.1	Nordea 1 SICAV-Emerg Mkts Bond Fund	1.139	EUR	141,03	160.565,48	0,00	160.565,48
3.1	Nordea 1 SICAV-Flexible Fixed Income Fund	1.712	EUR	113,52	194.389,26	0,00	194.389,26
3.2	Fundos não harmonizados	250		0	237.975,00	0,00	237.975,00
3.2	Fundo Energia FCR - CAT B	250	EUR	951,9	237.975,00	0,00	237.975,00
4	IMOBILIÁRIO	11.423		0	201.240,13	0,00	201.240,13
4.2	Unidades de participação de fundos de investimento imobiliário	11.423		0	201.240,13	0,00	201.240,13
4.2	CA Património Crescente	11.423	EUR	17,6171	201.240,13	0,00	201.240,13
5	LIQUIDEZ	0		0	1.559.579,66	0,00	1.559.579,66
5.1	À vista	0		0	1.904.669,82	0,00	1.904.669,82
5.1.2	Depósitos à ordem	0		0	1.904.669,82	0,00	1.904.669,82
5.1.2	EUR - BEST	0	EUR	0	121.596,35	0,00	121.596,35
5.1.2	EUR - CCCAM	0	EUR	0	1.136.367,07	0,00	1.136.367,07
5.1.2	EUR - FUTUROS - ALTURA	0	EUR	0	646.706,40	0,00	646.706,40
5.3	Devedores e Credores	0		0	-345.090,16	0,00	-345.090,16
5.3.1	Operações a Liquidar	0		0	-239.999,88	0,00	-239.999,88
5.3.1	Diferimento do Juro das OPLs	0	EUR	0	0,12	0,00	0,12
5.3.1	Liquidação Parcial Operações	0	EUR	0	-240.000,00	0,00	-240.000,00
5.3.2	Impostos	0		0	9.403,02	0,00	9.403,02
5.3.2	FP - IRS - Cat E	0	EUR	0	-53,43	0,00	-53,43
5.3.2	Imposto a recuperar - Portugal	0	EUR	0	14.036,03	0,00	14.036,03
5.3.2	Imposto de Selo - FP - CD	0	EUR	0	-275,45	0,00	-275,45
5.3.2	Imposto do Selo - FP CG	0	EUR	0	-4.304,13	0,00	-4.304,13
5.3.3	Comissões	0		0	-114.493,30	0,00	-114.493,30
5.3.3	FP - Comissão de Depósito	0	EUR	0	-6.886,80	0,00	-6.886,80
5.3.3	FP - Comissão de Gestão	0	EUR	0	-107.606,50	0,00	-107.606,50
	TOTAL		EUR		35.460.228,37	118.392,05	35.578.621,42