

**COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA**

Valor da Unidade de Participação: 7,00042  
Nº de Unidades de Participação: 5 242 573,08809

DESIGNAÇÃO	QUANTIDADE	MOEDA	COTAÇÃO/ PREÇO UNIT. (EM EUROS)	VALOR	JUROS DECORRIDOS (EM EUROS)	MONTANTE GLOBAL (EM EUROS)
<b>VALORES MOBILIÁRIOS COTADOS</b>	<b>29 068 947</b>			<b>32 014 181,30</b>	<b>57 127,41</b>	<b>32 071 308,71</b>
Mercado de cotações oficiais de bolsa de valores portuguesa e outros mercados regulamentados	4 406 376			3 996 062,55	11 844,60	4 007 907,15
Títulos de dívida pública	2 975 500			2 975 077,31	11 844,60	2 986 921,91
AZORES 1.006% 15/06/29	300 000	EUR	103,324	309 972,00	124,03	310 096,03
AZORES 1.85% 21/08/25	187 500	EUR	103,849	194 717,81	3 015,88	197 733,69
PGB 0.475% 18/10/30	1 727 000	EUR	101,966	1 760 952,82	5 731,03	1 766 683,85
PGB 1% 12/04/52	651 000	EUR	91,268	594 154,68	2 496,99	596 651,67
PGB Float 23/07/25	110 000	EUR	104,8	115 280,00	476,67	115 756,67
Acções	1 430 876			1 020 985,24	0,00	1 020 985,24
B.Comercial Português - Nominativas	1 000 000	EUR	0,14	135 000,00	0,00	135 000,00
EDP-Energias de Portugal SA	22 950	EUR	4,47	102 586,50	0,00	102 586,50
Galp Energia, SGPS, SA (Privat.)	13 500	EUR	9,15	123 552,00	0,00	123 552,00
Jerónimo Martins, SGPS, SA	4 800	EUR	15,38	73 824,00	0,00	73 824,00
NOS, SGPS	61 006	EUR	2,96	180 333,74	0,00	180 333,74
REN-Redes Energéticas Nacionais, SA	59 600	EUR	2,34	139 464,00	0,00	139 464,00
Sonae - SGPS	244 520	EUR	0,8	195 616,00	0,00	195 616,00
The Navigator Company SA	24 500	EUR	2,88	70 609,00	0,00	70 609,00
Mercado de cotações oficiais de bolsa valores de outros Estados-membro da União Europeia	23 762 571			27 118 332,75	44 738,44	27 163 071,19
Títulos de dívida pública	12 565 000			12 825 574,29	27 067,33	12 852 641,62
BTPS 0.9% 01/04/31	1 745 000	EUR	101,16	1 765 242,00	3 872,47	1 769 114,47
BTPS 1.5% 30/04/45	352 000	EUR	97,252	342 327,04	880,00	343 207,04
CCTS Float 15/12/23	400 000	EUR	100,76	403 040,00	4,83	403 044,83
DBR 0% 15/02/31	5 794 000	EUR	102,46	5 936 532,40	0,00	5 936 532,40
FRTR 0.5% 25/06/44	357 000	EUR	95,485	340 881,45	24,45	340 905,90
ROMANI 2% 14/04/33	2 067 000	EUR	99,226	2 051 001,42	8 721,04	2 059 722,46
SPGB 0.4% 30/04/22	232 000	EUR	100,812	233 883,84	155,09	234 038,93
SPGB 1.25% 31/10/30	1 618 000	EUR	108,323	1 752 666,14	13 409,45	1 766 075,59
Obrigações diversas	11 000 000			11 058 535,00	17 671,11	11 076 206,11
BACR 0.75% 09/06/25-24	150 000	EUR	101,686	152 529,00	64,73	152 593,73
BACRED Float 18/05/22	400 000	EUR	100,458	401 832,00	118,01	401 950,01
BAYNGR 0.05% 12/01/25 - 24	100 000	EUR	99,754	99 754,00	23,15	99 777,15
BAYNGR Float 26/06/22	300 000	EUR	100,294	300 882,00	0,40	300 882,40
BKIASM 0.75% 09/07/26	200 000	EUR	102,382	204 764,00	1 463,01	206 227,01
BMW Float 24/06/22	400 000	EUR	100,452	401 808,00	4,00	401 812,00
BNFP 0% 01/12/25	100 000	EUR	100,406	100 406,00	0,00	100 406,00
CONGR 0% 12/09/23	250 000	EUR	100,12	250 300,00	0,00	250 300,00
CS Float 20/12/22	200 000	EUR	101,552	203 104,00	54,83	203 158,83
DE Float 03/10/22	200 000	EUR	100,46	200 920,00	0,00	200 920,00
ERFFP 2.125% 25/07/24	100 000	EUR	105,8	105 800,00	1 979,45	107 779,45
FCABNK 0% 16/04/24	350 000	EUR	99,942	349 797,00	0,00	349 797,00
GALPNA 1.375% 19/09/23	200 000	EUR	102,871	205 742,00	2 139,73	207 881,73
GS Float 21/04/23-22	20 000	EUR	100,183	20 036,60	0,51	20 037,11
GS Float 26/09/23-22	100 000	EUR	100,263	100 263,00	0,91	100 263,91
HAR 2% 27/05/22	400 000	EUR	101,458	405 832,00	745,21	406 577,21
LSELN 0% 06/04/25	500 000	EUR	99,965	499 825,00	0,00	499 825,00
Lloyds Float 21/06/24	150 000	EUR	101,296	151 944,00	8,89	151 952,89
MAN 1.875% 11/09/22	200 000	EUR	101,854	203 708,00	3 000,00	206 708,00
MS Float 08/11/22	300 000	EUR	100,214	300 642,00	74,64	300 716,64
NDAQ 1.75% 19/05/23	400 000	EUR	103,062	412 248,00	805,48	413 053,48
NHYNO 1.125% 11/04/25	200 000	EUR	103,281	206 562,00	493,15	207 055,15
NOSPL 1.125% 02/05/23	400 000	EUR	101,527	406 108,00	727,40	406 835,40
PARPUB Float 22/10/27-22	300 000	EUR	96,621	289 863,00	0,00	289 863,00
PBBGR Float 28/07/23	400 000	EUR	100,972	403 888,00	253,40	404 141,40
PKOBP 0.75% 25/07/21	440 000	EUR	99,918	439 639,20	3 073,97	442 713,17
RBS Float 27/09/21	300 000	EUR	100,19	300 570,00	9,05	300 579,05

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA [continuação]

DESIGNAÇÃO	QUANTIDADE	MOEDA	COTAÇÃO/ PREÇO UNIT. (EM EUROS)	VALOR	JUROS DECORRIDOS (EM EUROS)	MONTANTE GLOBAL (EM EUROS)
RCFFP 1.5% 03/04/24	100 000	EUR	103,625	103 625,00	361,64	103 986,64
RENAUL 0.75% 10/04/23	200 000	EUR	101,236	202 472,00	332,88	202 804,88
RENEPL 0.5% 16/04/29	500 000	EUR	99,97	499 850,00	513,70	500 363,70
REPSM 0.375% 06/07/29	400 000	EUR	99,548	398 192,00	0,00	398 192,00
SANTAN Float 21/03/22	100 000	EUR	100,659	100 659,00	11,95	100 670,95
SCBNOR 0.125% 25/02/25	300 000	EUR	100,104	300 312,00	128,42	300 440,42
SEVFP 0% 09/06/26	400 000	EUR	99,676	398 704,00	0,00	398 704,00
SOCGEN 0.125% 18/02/28	700 000	EUR	98,795	691 565,00	316,44	691 881,44
SRGIM Float 02/08/24	200 000	EUR	100,373	200 746,00	0,00	200 746,00
UBS Float 20/09/22-21	200 000	EUR	100,116	200 232,00	8,72	200 240,72
UCGIM 0.325% 19/01/26	340 000	EUR	99,768	339 211,20	490,44	339 701,64
UCGIM 0.8% 05/07/29 - 28	200 000	EUR	100,201	200 402,00	0,00	200 402,00
VW Float 01/08/22	300 000	EUR	101,266	303 798,00	467,00	304 265,00
Acções	11 050			105 306,50	0,00	105 306,50
Siemens Gamesa SA	2 550	EUR	28,16	71 808,00	0,00	71 808,00
Telefonica (Espania) SA	8 500	EUR	3,94	33 498,50	0,00	33 498,50
Unidades de participação de fundos de investimento fechados	186 521			3 128 916,96	0,00	3 128 916,96
BBVA-ACCION IBEX 35 ETF	66 000	EUR	8,9	587 400,00	0,00	587 400,00
Ishares Stoxx Europe 600 Telecoms UCITS ETF (DE)	20 500	EUR	21,825	447 412,50	0,00	447 412,50
Ishares Stoxx Europe 600 UCITS ETF (DE)	12 697	EUR	45,02	571 618,94	0,00	571 618,94
Ishares Stoxx Europe 600 Utilities ETF	3 450	EUR	37,845	130 565,25	0,00	130 565,25
L&G Cyber Security UCITS ETF	3 185	EUR	21,56	68 668,60	0,00	68 668,60
Lyxor MSCI Emerging Markets-A	10 500	EUR	13,311	139 765,50	0,00	139 765,50
SPDR ETF-Bib Barclays 10+Y US Treasury Bond	15 764	EUR	28,219000254	444 844,32	0,00	444 844,32
UBS ETF-Bib Barclays US 10+Y Treasury Bond EUR	39 325	EUR	10,658	419 125,85	0,00	419 125,85
Xtrackers Euro Stoxx Quality Dividend 50 UCITS ETF	15 100	EUR	21,16	319 516,00	0,00	319 516,00
Mercado de cotações oficiais de bolsas de Estado não membro da União Europeia	900 000			899 786,00	544,37	900 330,37
Obrigações diversas	900 000			899 786,00	544,37	900 330,37
FDX 0.45% 04/05/29	400 000	EUR	99,594	398 376,00	281,10	398 657,10
KO 0.4% 06/05/30	400 000	EUR	100,051	400 204,00	241,10	400 445,10
T Float 05/09/23	100 000	EUR	101,206	101 206,00	22,17	101 228,17
<b>UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO DE INSTITUIÇÕES DE INVESTIMENTO COLECTIVO</b>	<b>128 854</b>			<b>2 832 560,73</b>	<b>0,00</b>	<b>2 832 560,73</b>
Fundos harmonizados	128 604			2 606 675,73	0,00	2 606 675,73
BNY Mellon Global Funds-Emerg Mkts Debt AE	87 270	EUR	2,078999998	181 434,86	0,00	181 434,86
Candriam Equities L Europe OPT5	1 272	EUR	224,209996619	285 157,00	0,00	285 157,00
DNCA Invest Miuri	725	EUR	129,790000948	94 055,53	0,00	94 055,53
Fidelity Funds-European Dynamic Growth Fund-Y ACC	7 911	EUR	30,970000088	244 994,07	0,00	244 994,07
Fidelity Funds-World Fund A	7 496	EUR	33,4499996	250 745,88	0,00	250 745,88
IMGA European Equities - Fundo de Investimento Aberto de Acções	8 788	EUR	15,117400246	132 845,55	0,00	132 845,55
Invesco Global Targeted Returns Eur	2 226	EUR	10,551800830	23 484,51	0,00	23 484,51
JPMorgan Funds-Europe Strategic Growth -A-A	7 091	EUR	40,539999492	287 462,65	0,00	287 462,65
LM-WA Macro Opport BD	880	EUR	131,570001182	115 719,50	0,00	115 719,50
Natix AM FDS-Seeyond MINV-IA	9	EUR	23056,240055	212 991,24	0,00	212 991,24
Nordea 1 SICAV-Emerg Mkts Bond Fund	1 324	EUR	137,020003081	181 441,34	0,00	181 441,34
Nordea 1 SICAV-Flexible Fixed Income Fund	462	EUR	114,290000195	52 799,58	0,00	52 799,58
Pictet - Global Megatrend Selection-I	748	EUR	391,969998741	293 108,09	0,00	293 108,09
Pictet Multi Asset Global Opportunities	433	EUR	138,19999358	59 842,38	0,00	59 842,38
Schroder Int. Selection Fund - Eur	1 971	EUR	96,720500771	190 593,55	0,00	190 593,55
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
<b>IMOBILIÁRIO</b>	<b>9 685</b>			<b>180 044,15</b>	<b>0,00</b>	<b>180 044,15</b>
Unidades de participação de fundos de investimento imobiliário	9 685			180 044,15	0,00	180 044,15
CA Património Crescente	9 685	EUR	18,59	180 044,15	0,00	180 044,15
<b>LIQUIDEZ</b>				<b>1 616 273,90</b>	<b>0,00</b>	<b>1 616 273,90</b>
À vista				2 626 176,32	0,00	2 626 176,32
Depósitos à ordem				2 626 176,32	0,00	2 626 176,32
EUR - CCCAM		EUR		1 885 245,32	0,00	1 885 245,32
EUR - FUTUROS - ALTURA		EUR		515 960,50	0,00	515 960,50

30 de Junho de 2021

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA [continuação]

DESIGNAÇÃO	QUANTIDADE	MOEDA	COTAÇÃO/ PREÇO UNIT. (EM EUROS)	VALOR	JUROS DECORRIDOS (EM EUROS)	MONTANTE GLOBAL (EM EUROS)
EUR - FUTUROS - CMG ALTURA		EUR		224 970,50	0,00	224 970,50
Devedores e Credores				-1 009 902,42	0,00	-1 009 902,42
Operações a Liquidar				-883 884,84	0,00	-883 884,84
Diferimento do Juro das OPLs		EUR		7,52	0,00	7,52
Liquidação Parcial Operações		EUR		-144 000,00	0,00	-144 000,00
OPL - Acções - Compra (Bolsa)		EUR		-74 128,65	0,00	-74 128,65
OPL - Acções - Venda (Bolsa)		EUR		64 661,21	0,00	64 661,21
OPL - Obrigações - Compra (Fora de Bolsa) - Juro Bruto		EUR		-208 067,26	0,00	-208 067,26
OPL - Obrigações - Compra (Mercado Primário)		EUR		-596 214,00	0,00	-596 214,00
OPL - Unid. Participação - Venda (Bolsa)		EUR		71 722,68	0,00	71 722,68
Operações a Liquidar		EUR		2 133,66	0,00	2 133,66
Impostos				-7 170,41	0,00	-7 170,41
FP - IRS - Cat E		EUR		-150,65	0,00	-150,65
FP - IRS categoria H		EUR		-157,00	0,00	-157,00
Imposto a Entregar ao Estado - Dividendos (Isentos)		EUR		-2 893,64	0,00	-2 893,64
Imposto a Recuperar - Espanha		EUR		784,55	0,00	784,55
Imposto de Selo - FP - CD		EUR		-285,91	0,00	-285,91
Imposto do Selo - FP CG		EUR		-4 467,76	0,00	-4 467,76
Comissões				-118 847,17	0,00	-118 847,17
FP - Comissão de Depósito		EUR		-7 148,71	0,00	-7 148,71
FP - Comissão de Gestão		EUR		-111 698,46	0,00	-111 698,46
<b>OPERAÇÕES COM PRODUTOS DERIVADOS</b>	<b>-74</b>			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
Em mercado regulamentado	-74			0,00	0,00	0,00
Futuros	-74			0,00	0,00	0,00
Euro-BTP Future SET 21(FBTP-ALTURA)	-40	EUR	151,41	0,00	0,00	0,00
Euro-OAT Future SET 21 (FOAT-ALTURA)	-34	EUR	159,04	0,00	0,00	0,00
<b>TOTAL</b>				<b>36 643 060,08</b>	<b>57 127,41</b>	<b>36 700 187,49</b>