

**CARTEIRA DETALHADA**

Carteira em 2017.12.31

Designação	Moeda	Quant./ Mont. Nom.	Cotação	Juros Corridos	Valor Global	%
<b>Valores Mobiliários Cotados</b>						
Mercado de Cotações Oficiais de Bolsa de Valores Portuguesa						
Obrigações Diversas						
BRISA-CONCESSAO RODOVIARIA TV 07.01.2022	EUR	30,000,000	100.00%	48,000.00	30,048,000.00	3.21%
CGD-3.75%-18.01.2018	EUR	4,600,000	100.00%	163,993.15	4,763,830.86	0.51%
CIN - 2014/2019	EUR	12,000,000	100.00%	12,312.00	12,012,312.00	1.28%
GRUPO PESTANA 2014/2020	EUR	40,000,000	100.00%	486,111.10	40,486,111.10	4.33%
MEDIA CAPITAL 2014-2019	EUR	32,000,000	100.00%	563,191.11	32,563,191.11	3.48%
SECIL 2015-2020	EUR	25,000,000	100.00%	59,027.77	25,059,027.77	2.68%
SEMAPA 2014/2019	EUR	26,713,000	100.06%	165,620.61	26,895,088.01	2.88%
ZON OPTIMUS 2014-2019	EUR	67,500,000	99.92%	216,937.50	67,660,052.71	7.24%
					Sub-Total:	25.61%
Mercado de Cotações Oficiais de Bolsa de Valores de Estados Membros da União Europeia						
Títulos de Dívida Pública						
BUONI ORDINARI DEL TES-CZ-31.01.2018	EUR	70,000,000	100.05%		70,032,200.00	7.49%
BUONI POLIENNALI DEL TE-CZ-29.06.2018	EUR	5,000,000	100.22%		5,010,750.00	0.54%
REPUBLICA DE PORTUGAL TV - 29.01.2018	EUR	30,000,000	100.00%	284,070.00	30,284,070.00	3.24%
SPAIN LETRAS DEL TESORO-19.01.2018-CZ	EUR	225,000,000	100.04%		225,087,750.00	24.07%
SPAIN LETRAS DEL TESORO-CZ-15.06.2018	EUR	65,000,000	100.23%		65,149,500.00	6.97%
					Sub-Total:	42.30%
Obrigações Diversas						
BANCO DE SABADELL SA-3.375%-13.01.2018	EUR	8,200,000	99.99%	259,310.96	8,458,826.18	0.90%
BANIF - TAX.VAR. (30.12.2015)	EUR	10,000,000	100.00%		10,000,000.00	1.07%
EDP FINANCE BV-4.875%-14.09.2020	EUR	45,000,000	99.72%	649,109.59	45,523,462.99	4.87%
EDP FINANCE BV-TV 26.06.2019	USD	70,000,000	100.00%	28,650.46	58,391,270.42	6.24%
HEAT MEZZANINE-S.I-06 C.B1-13.04.2018	EUR	3,300,000	2.00%	4,026.37	70,026.37	0.01%
IBERCAJA(CA.ZARAGOZA A.R.)TV-20.04.2018	EUR	5,000,000	100.00%	5,410.00	5,005,410.00	0.54%
IBERCAJA(CA.ZARAGOZA A.R.)TV-25.04.2019	EUR	4,400,000	100.00%	4,348.30	4,404,348.30	0.47%
LUSITANO MTGE-SR.1-CL.D-TV (15.12.2035)	EUR	1,000,000	93.00%	1,053.78	931,053.78	0.10%
LUSITANO MTGE-SR.2-CL.D-TV (16.11.2046)	EUR	500,000	85.53%	1,294.38	428,944.38	0.05%
NATIONAL WESTMINSTER BK-T.V.-PERP	EUR	377,000	88.72%	1,658.17	336,136.34	0.04%
REN-REDES ENERG.NAC.-TV-16.01.2020	EUR	30,900,000	100.00%	288,396.58	31,188,396.58	3.34%
SEMAPA 2014/2020	EUR	30,000,000	100.00%	71,713.33	30,071,713.33	3.22%
					Sub-Total:	20.83%
<b>Outros Valores</b>						
Valores Mobiliários Nacionais Não Cotados						
Obrigações Diversas						
AUTO-SUECO - 2013 / 2018	EUR	12,500,000	100.00%	285,589.58	12,785,589.58	1.37%
EFANOR INVESTIMENTOS SGPS SA-2014/2019	EUR	8,333,333	100.00%	63,807.87	8,397,141.20	0.90%
					Sub-Total:	2.27%
Valores Mobiliários Estrangeiros Não Cotados						
Obrigações Diversas						
RENOVA-1.6%-2015-2021	EUR	11,250,000	100.93%		11,354,896.39	1.21%
					Sub-Total:	1.21%
<b>Liquidez</b>						
A vista						
Depósitos à Ordem						
BCP/Millennium - EUR					456.93	0.00%
CGD - EUR					350.94	0.00%

**CARTEIRA DETALHADA**

Carteira em 2017.12.31

Designação	Moeda	Quant./ Mont. Nom.	Cotação	Juros Corridos	Valor Global	%
<b>Depósitos à Ordem</b>						
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)					14,838,891.17	1.59%
LA CAIXA - EUR					491.19	0.00%
NB - EUR					8.82	0.00%
					<b>Sub-Total:</b>	<b>1.59%</b>
<b>A prazo</b>						
<b>Depósitos com Pré-Aviso e a Prazo</b>						
D.P. - SANTANDER - 171227..180627, .01%		1	20,000,000.0	22.22	20,000,022.22	2.14%
Depósitos a prazo - dep. no BPI		1			11,000,000.00	1.18%
					<b>Sub-Total:</b>	<b>3.32%</b>
<b>Outros Valores a Regularizar</b>						
<b>Valores Activos</b>						
<b>Valores Activos</b>						
Depósito à Ordem-Cnt remun.(fora do BPI)					866,755.61	0.09%
Posições a Liquidar - títulos					-4,587,723.00	-0.49%
Terceiros					-10,002,579.63	-1.07%
					<b>Sub-Total:</b>	<b>-1.47%</b>
<b>Valores Passivos</b>						
<b>Valores Passivos</b>						
Posições a Liquidar - títulos					-0.38	0.00%
Terceiros					-9,549,902.24	-1.02%
					<b>Sub-Total:</b>	<b>-1.02%</b>
<b>Operações Cambiais</b>						
<b>Em mercado regulamentado</b>						
<b>Futuros</b>						
FUT EUR CURR - MAR18	USD	495			0.00	0.00%
					<b>Sub-Total:</b>	<b>0.00%</b>
<b>Total das aplicações:</b>					<b>935,107,371.20</b>	
<b>Número de Unidades de Participação em Circulação:</b>						