

CARTEIRA DETALHADA

Carteira em 2017.12.31

Designação	Moeda	Quant./ Mont. Nom.	Cotação	Juros Corridos	Valor Global	%
Valores Mobiliários Cotados						
Mercado de Cotações Oficiais de Bolsa de Valores Portuguesa						
Obrigações Diversas						
BRISA-CONCESSAO RODOVIARIA TV 07.01.2022	EUR	15,000,000	100.00%	24,000.00	15,024,000.00	2.35%
CGD-3.75%-18.01.2018	EUR	4,000,000	100.00%	142,602.74	4,142,461.55	0.65%
MEDIA CAPITAL 2014-2019	EUR	4,000,000	100.00%	70,398.89	4,070,398.89	0.64%
SECIL 2015-2020	EUR	7,500,000	100.00%	17,708.33	7,517,708.33	1.17%
ZON OPTIMUS 2014-2019	EUR	25,000,000	99.92%	80,347.22	25,059,278.95	3.91%
					Sub-Total:	8.71%
Mercado de Cotações Oficiais de Bolsa de Valores de Estados Membros da União Europeia						
Títulos de Dívida Pública						
BONOS Y OBLI DEL ESTADO-0.25%-30.04.2018	EUR	81,000,000	100.21%	135,924.66	81,301,974.66	12.69%
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.1%-30.07.2018	EUR	40,000,000	102.59%	691,945.21	41,729,545.21	6.51%
BUONI POLIENALI DEL TES-0.25%-15.05.2018	EUR	105,000,000	100.27%	33,082.19	105,312,382.19	16.44%
BUONI POLIENNAL.DEL TES-0.75%-15.01.2018	EUR	60,000,000	100.03%	208,356.16	60,226,356.16	9.40%
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-01.02.2018	EUR	70,000,000	100.37%	1,311,780.82	71,567,280.82	11.17%
REPUBLICA DE PORTUGAL TV - 29.01.2018	EUR	18,000,000	100.00%	170,442.00	18,170,442.00	2.84%
SPAIN LETRAS DEL TESORO-19.01.2018-CZ	EUR	11,000,000	100.04%		11,004,290.00	1.72%
SPAIN LETRAS DEL TESORO-CZ-15.06.2018	EUR	30,000,000	100.23%		30,069,000.00	4.69%
					Sub-Total:	65.47%
Obrigações Diversas						
BANCO DE SABADELL SA-3.375%-13.01.2018	EUR	7,100,000	99.99%	224,525.34	7,324,105.68	1.14%
BANIF - TAX.VAR. (30.12.2015)	EUR	1,800,000	100.00%		1,800,000.00	0.28%
EDDYSTONE FIN.SR2006-1 CLA1B 19.04.2021	EUR	151,788	87.05%	44.94	132,177.23	0.02%
EDP FINANCE BV-4.875%-14.09.2020	EUR	33,500,000	99.72%	483,226.03	33,889,689.13	5.29%
EDP FINANCE BV-TV 26.06.2019	USD	17,000,000	100.00%	6,957.97	14,180,737.10	2.21%
HEAT MEZZANINE-S.I-06 C.B1-13.04.2018	EUR	700,000	2.00%	854.08	14,854.08	0.00%
IBERCAJA(CA.ZARAGOZA A.R.)TV-20.04.2018	EUR	1,000,000	100.00%	1,082.00	1,001,082.00	0.16%
IBERCAJA(CA.ZARAGOZA A.R.)TV-25.04.2019	EUR	4,000,000	100.00%	3,953.00	4,003,953.00	0.63%
LUSITANO MTGE-SR.5-CL.A-TV (15.07.2059)	EUR	70,357	94.14%		66,234.35	0.01%
REN-REDES ENERG.NAC.-TV-16.01.2020	EUR	26,400,000	100.00%	246,397.08	26,646,397.08	4.16%
SEMAPA 2014/2020	EUR	5,000,000	100.00%	11,952.22	5,011,952.22	0.78%
					Sub-Total:	14.69%
Outros Valores						
Valores Mobiliários Nacionais Não Cotados						
Obrigações Diversas						
AUTO-SUECO - 2013 / 2018	EUR	2,000,000	100.00%	45,694.33	2,045,694.33	0.32%
					Sub-Total:	0.32%
Valores Mobiliários Estrangeiros Não Cotados						
Obrigações Diversas						
RENOVA-1.6%-2015-2021	EUR	2,250,000	100.93%		2,270,979.25	0.35%
					Sub-Total:	0.35%
Liquidez						
A vista						
Depósitos à Ordem						
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)					6,460,045.82	1.01%
					Sub-Total:	1.01%
A prazo						
Depósitos com Pré-Aviso e a Prazo						

CARTEIRA DETALHADA

Carteira em 2017.12.31

Designação	Moeda	Quant./ Mont. Nom.	Cotação	Juros Corridos	Valor Global	%
Depósitos com Pré-Aviso e a Prazo						
D.P. - BCP - 171103..180503, .20%		1	5,000,000.00	1,611.11	5,001,611.11	0.78%
D.P. - BCP - 171103..180803, .25%		1	10,000,000.0	4,027.78	10,004,027.78	1.56%
D.P. - BCP - 171103..181102, .26%		1	15,084,448.2	6,318.71	15,090,766.98	2.36%
D.P. - CGD - 170907..180907, .00%		1	10,002,541.6		10,002,541.67	1.56%
D.P. - CGD - 171207..181207, .00%		1	20,006,600.0		20,006,600.00	3.12%
Depósitos a prazo - dep. no BPI		1			6,000,000.00	0.94%
					Sub-Total:	10.32%
Outros Valores a Regularizar						
Valores Activos						
Valores Activos						
Depósito à Ordem-Cnt remun.(fora do BPI)					210,122.57	0.03%
Posições a Liquidar - títulos					80,671.14	0.01%
Terceiros					-1,800,160.15	-0.28%
					Sub-Total:	-0.24%
Valores Passivos						
Valores Passivos						
Posições a Liquidar - títulos					18,000.19	0.00%
Terceiros					-4,736,439.68	-0.74%
					Sub-Total:	-0.74%
Operações Cambiais						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
FUT EUR CURR - MAR18	USD	120			0.00	0.00%
					Sub-Total:	0.00%
Total das aplicações:					640,568,661.43	
Número de Unidades de Participação em Circulação:						