

FUNDO DE PENSÕES ABERTO - SGF EMPRESAS PRUDENTE

Valor Patrimonial Unitário em 30/09/2018 5,67684 EUR
N.º Unidades de Participação em circulação 1 099 183

| | Quantidade | Moeda | Cot. Moeda | Cot. Euro | Jur Dec | Valor (Euro) |
|---|--------------|-------|------------|-----------|---------|-------------------|
| 1 Valores mobiliários cotados | | | | | | |
| 11 Mercado cot. ofic. de B.V. Port. | | | | | | |
| 114 Acções | | | | | | |
| 12 Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE | | | | | | |
| BES | 35 430,00 | EUR | | | | 0,00 |
| 121 Títulos de dívida pública | | | | | | |
| UK TSY 1,75% 22/07/2019 | 52 000,00 | GBP | 100,76 | 89,75 | 195,93 | 59 021,19 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 59 021,19 |
| 122 Outros fundos públicos e equiparados | | | | | | |
| EIB 0% 27/08/2021 BRL | 435 000,00 | BRL | 78,42 | 368,58 | | 72 577,26 |
| EIB 1,125% 15/05/2020 NOK | 1 050 000,00 | NOK | 99,76 | 943,76 | 472,07 | 111 185,16 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 183 762,42 |
| 123 Obrigações diversas | | | | | | |
| OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021) | 2 000,00 | EUR | 100,00 | 100,00 | 6,90 | 2 006,90 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 2 006,90 |
| 3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo | | | | | | |
| 31 Fundos harmonizados | | | | | | |
| AXA Global Inflation Short Duration | 2 688,21 | EUR | 99,21 | 99,21 | | 266 697,02 |
| BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov. | 2 917,47 | EUR | 165,92 | 165,92 | | 484 067,12 |
| Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return | 502,87 | EUR | 136,16 | 136,16 | | 68 470,78 |
| Bluebay GLB SOV OPP-M EUR | 791,73 | EUR | 105,14 | 105,14 | | 83 242,28 |
| CANDRIAM Euro High Yield | 139,69 | EUR | 1 209,33 | 1 209,33 | | 168 927,68 |
| COBAS Lux SICAV Global Fund | 2,25 | EUR | 19 338,67 | 19 338,67 | | 43 502,34 |
| Candriam Long Short Global Credit | 743,89 | EUR | 102,80 | 102,80 | | 76 471,79 |
| Central Fund Canada LTD | 8 763,00 | USD | 11,68 | 13,55 | | 88 196,58 |
| ETFS AGRICULTURE | 5 629,00 | EUR | 3,56 | 3,56 | | 20 044,87 |
| ETFS Copper | 1 339,00 | EUR | 22,37 | 22,37 | | 29 946,74 |
| FISHER EMERGING MARKETS EQ-EUR UH | 396,05 | EUR | 128,07 | 128,07 | | 50 721,74 |
| FUNDSMITH Equity Fund | 4 046,18 | EUR | 35,88 | 35,88 | | 145 176,94 |
| First Trust Eurozone ALPHADX | 843,00 | EUR | 32,35 | 32,35 | | 27 266,84 |
| GROUPAMA Enterprises - IC | 66,89 | EUR | 2 277,71 | 2 277,71 | | 152 358,76 |
| GROUPAMA Trésorerie IC | 6,13 | EUR | 40 285,98 | 40 285,98 | | 247 134,34 |
| H2O MODERATO-IC | 1,32 | EUR | 86 452,05 | 86 452,05 | | 114 056,19 |
| HENDERSON Horizon Pan-European Alpha | 4 504,82 | EUR | 16,53 | 16,53 | | 74 464,61 |
| INRIS UCITS R Parus I EUR HD | 712,35 | EUR | 106,47 | 106,47 | | 75 844,22 |
| INVESCO Pan European Structured Equity | 5 173,79 | EUR | 13,90 | 13,90 | | 71 915,68 |
| ISHARES MSCI Emerging Markets ETF | 320,00 | USD | 42,92 | 49,81 | | 11 834,93 |
| ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED | 858,00 | EUR | 52,55 | 52,55 | | 45 087,90 |
| ISHARES S&P 500 EUR | 467,00 | EUR | 65,47 | 65,47 | | 30 572,62 |
| JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY | 22 848,11 | EUR | 12,56 | 12,56 | | 286 972,26 |
| Jupiter Dynamic Bond Fund | 8 367,00 | EUR | 10,41 | 10,41 | | 87 100,47 |
| KEMPEN Euro Credit | 156,60 | EUR | 1 397,78 | 1 397,78 | | 218 892,35 |
| L&G Emerging Markets Short Duration | 132 625,51 | EUR | 0,98 | 0,98 | | 129 362,92 |
| Lyxor BTP 10Y | 489,00 | EUR | 127,68 | 127,68 | | 62 435,52 |
| Lyxor Bund 1X Inverse | 2 667,00 | EUR | 47,48 | 47,48 | | 126 621,16 |
| M&G Optimal Income Fd C-H | 16 345,99 | EUR | 21,10 | 21,10 | | 344 859,59 |
| MAN GLG European Inc Opportunities | 820,20 | EUR | 99,41 | 99,41 | | 81 536,18 |
| MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I | 23,26 | EUR | 1 263,50 | 1 263,50 | | 29 388,74 |
| ML AQR Global Relative Value | 589,84 | EUR | 106,10 | 106,10 | | 62 581,60 |

| | | | | | | |
|------------|--|-----------|-----|-----------|-----------|---------------------|
| | Merrill Lynch Inv.Sol.-Marshall Wace TOPS | 550,97 | EUR | 145,66 | 145,66 | 80 254,87 |
| | NATIXIS TRESORERIE - IC | 13,06 | EUR | 12 510,67 | 12 510,67 | 163 351,82 |
| | ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR | 705,56 | EUR | 37,23 | 37,23 | 26 267,88 |
| | PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD | 1 727,00 | USD | 15,26 | 17,71 | 22 709,26 |
| | PIMCO FD-LD GLB IGR C- IEURHA | 27 616,71 | EUR | 10,43 | 10,43 | 288 042,26 |
| | PIMCO GIS-INCOME FD (INST) | 21 398,01 | EUR | 13,42 | 13,42 | 287 161,24 |
| | ROBECO BP US PREM EQ.-IHEUR | 210,93 | EUR | 262,29 | 262,29 | 55 324,54 |
| | STEWART Investors Asia Pacific Leaders | 12 580,02 | EUR | 2,28 | 2,28 | 28 673,64 |
| | THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS | 1 839,00 | USD | 15,30 | 17,76 | 24 245,39 |
| | VECTOR FUND - NAVIGATOR -I1 | 92,08 | EUR | 1 747,62 | 1 747,62 | 160 926,09 |
| | Vaneck Vectors Gold Miners | 2 391,00 | USD | 18,52 | 21,49 | 38 157,21 |
| | Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund | 1 579,06 | EUR | 106,47 | 106,47 | 168 122,52 |
| | Winton Diversified Fund UC- EUR | 802,08 | EUR | 105,98 | 105,98 | 85 008,13 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 5 233 997,61 |
| 32 | Fundos não harmonizados | | | | | |
| | BANIF Global Private Equity Fund - FCR | 666,67 | EUR | 0,17 | 0,17 | 116,54 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 116,54 |
| 4 | Imobiliário | | | | | |
| 42 | U. P.'s de fundos de investimento imobiliário | | | | | |
| | CA Património Crescente | 14 737,00 | EUR | 16,39 | 16,39 | 241 599,85 |
| | IMOSOCIAL | 285,00 | EUR | 3,21 | 3,21 | 914,42 |
| | SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN | 421,00 | EUR | 15,29 | 15,29 | 6 437,09 |
| | SEB Immoinvest | 729,00 | EUR | 5,15 | 5,15 | 3 755,08 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 252 706,44 |
| 5 | Liquidez | | | | | |
| 51 | À vista | | | | | |
| 512 | Depósitos à ordem | | | | | |
| | BBVA - € | | EUR | | | 3 545,12 |
| | BBVA-USD | | USD | | | 9,81 |
| | CGD-EUR | | EUR | | | 195 881,94 |
| | Cx. Crédito Agrícola Mútuo | | EUR | | | 25,49 |
| | Millenium bcp | | EUR | | | 238 665,59 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 438 127,95 |
| 52 | A prazo | | | | | |
| 521 | Depósitos e outros equiparados | | | | | |
| 9 | Outros valores a regularizar | | EUR | | | 70 146,55 |
| | TOTAL DE APLICAÇÕES | | | | | 6 169 739,05 |
| | TOTAL DO FUNDO | | | | | 6 239 885,60 |

Lisboa, 30 de Setembro de 2018