

FUNDO DE PENSÕES ABERTO - SGF EMPRESAS PRUDENTE

Valor Patrimonial Unitário em 30/11/2018 5,56990 EUR
N.º Unidades de Participação em circulação 1 097 816

	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	100,61	89,29	368,01	59 317,27
SUB-TOTAL						59 317,27
122 Outros fundos públicos e equiparados						
EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	1 050 000,00	NOK	99,79	970,75	662,06	108 378,62
SUB-TOTAL						108 378,62
123 Obrigações diversas						
OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	2 000,00	EUR	100,00	100,00	11,92	2 011,92
SUB-TOTAL						2 011,92
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 917,47	EUR	165,93	165,93		484 096,29
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	502,87	EUR	136,92	136,92		68 852,96
Bluebay GLB SOV OPP-M EUR	791,73	EUR	100,27	100,27		79 386,57
CANDRIAM Euro High Yield	139,69	EUR	1 183,05	1 183,05		165 256,71
COBAS Lux SICAV Global Fund	2,25	EUR	16 955,83	16 955,83		38 142,14
Candriam Long Short Global Credit	743,89	EUR	102,51	102,51		76 256,06
Central Fund Canada LTD	8 763,00	USD	11,73	13,27		90 828,32
ETF WTI CRUDE OIL (EUR)	3 739,00	EUR	6,67	6,67		24 935,39
ETFS 5x Short USD Long EUR	3 266,00	EUR	10,83	10,83		35 357,72
ETFS AGRICULTURE	5 629,00	EUR	3,70	3,70		20 818,86
ETFS Copper	1 339,00	EUR	22,63	22,63		30 294,88
FISHER EMERGING MARKETS EQ-EUR UH	396,05	EUR	123,23	123,23		48 804,87
FUNDSMITH Equity Fund	4 046,18	EUR	34,71	34,71		140 442,91
First Trust Eurozone ALPHADX	843,00	EUR	28,59	28,59		24 101,37
GROUPAMA Enterprises - IC	66,89	EUR	2 276,59	2 276,59		152 283,84
GROUPAMA Trésorerie IC	3,08	EUR	40 268,03	40 268,03		124 206,74
H2O MODERATO-IC	1,32	EUR	85 973,46	85 973,46		113 424,79
HENDERSON Horizon Pan-European Alpha	4 504,82	EUR	15,95	15,95		71 851,82
INRIS UCITS R Parus I EUR HD	712,35	EUR	104,10	104,10		74 155,95
INVESCO Pan European Structured Equity	5 173,79	EUR	12,69	12,69		65 655,40
ISHARES MSCI Emerging Markets ETF	320,00	USD	41,08	46,49		11 615,85
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	858,00	EUR	47,94	47,94		41 132,52
ISHARES S&P 500 EUR	467,00	EUR	61,16	61,16		28 560,32
Ishares NASDAQ 100 USD	49,00	EUR	339,55	339,55		16 637,95
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	22 848,11	EUR	12,42	12,42		283 773,53
Jupiter Dynamic Bond Fund	8 367,00	EUR	10,29	10,29		86 096,43
KEMPEN Euro Credit	156,60	EUR	1 389,47	1 389,47		217 591,00
L&G Emerging Markets Short Duration	132 625,51	EUR	0,96	0,96		127 227,65
La Française Euro Inflation	153,27	EUR	1 728,78	1 728,78		264 970,80
Lindsell Train - GL-Equity EUR	95 053,84	EUR	1,14	1,14		108 076,21
Lyxor BTP 10Y	489,00	EUR	127,35	127,35		62 274,15
Lyxor Bund 1X Inverse	5 249,00	EUR	46,61	46,61		244 666,39
M&G Optimal Income Fd C-H	16 345,99	EUR	20,61	20,61		336 877,84

	MAN GLG European Inc Opportunities	820,20	EUR	92,49	92,49	75 860,39
	MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I	23,26	EUR	1 157,98	1 157,98	26 934,22
	ML AQR Global Relative Value	589,84	EUR	100,65	100,65	59 366,99
	Merrill Lynch Inv.Sol.-Marshall Wace TOPS	550,97	EUR	133,27	133,27	73 428,30
	NATIXIS TRESORERIE - IC	13,06	EUR	12 504,16	12 504,16	163 266,82
	ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	705,56	EUR	34,44	34,44	24 299,38
	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	1 727,00	USD	14,36	16,25	21 913,78
	PIMCO FD-LD GLB IGR C- IEURHA	27 616,71	EUR	10,38	10,38	286 661,43
	PIMCO GIS-INCOME FD (INST)	21 398,01	EUR	13,29	13,29	284 379,50
	ROBECO BP US PREM EQ.-IHEUR	210,93	EUR	242,72	242,72	51 196,66
	STEWART Investors Asia Pacific Leaders	12 580,02	EUR	2,26	2,26	28 484,94
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	1 839,00	USD	14,15	16,01	22 993,69
	VECTOR FUND - NAVIGATOR -I1	92,08	EUR	1 658,96	1 658,96	152 762,01
	Vaneck Vectors Gold Miners	2 391,00	USD	19,09	21,60	40 332,58
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 579,06	EUR	105,52	105,52	166 622,41
	Winton Diversified Fund UC- EUR	802,08	EUR	105,26	105,26	84 428,23
	SUB-TOTAL					5 321 585,56
32	Fundos não harmonizados					
	BANIF Global Private Equity Fund - FCR	666,67	EUR	0,19	0,19	124,51
	SUB-TOTAL					124,51
4	Imobiliário					
42	U. P.'s de fundos de investimento imobiliário					
	CA Património Crescente	14 737,00	EUR	16,51	16,51	243 284,29
	IMOSOCIAL	285,00	EUR	2,84	2,84	810,20
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	421,00	EUR	11,69	11,69	4 921,49
	SEB Immoinvest	729,00	EUR	5,35	5,35	3 900,88
	SUB-TOTAL					252 916,86
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			866,01
	BBVA-USD		USD			10,06
	CGD-EUR		EUR			170 738,38
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			25,49
	Millenium bcp		EUR			211 108,12
	SUB-TOTAL					382 748,06
52	A prazo					
521	Depósitos e outros equiparados					
9	Outros valores a regularizar		EUR			-12 360,46
	TOTAL DE APLICAÇÕES					6 127 082,80
	TOTAL DO FUNDO					6 114 722,34

Lisboa, 30 de Novembro de 2018