

FUNDO DE PENSÕES ABERTO - SGF EMPRESAS PRUDENTE

		Valor Patrimonial Unitário em 31/12/2018		5,51003 EUR			
		N.º Unidades de Participação em circulação		1 102 365			
	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	100,54	90,40	449,21	58 595,34
	SUB-TOTAL						58 595,34
122	Outros fundos públicos e equiparados						
	EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	1 050 000,00	NOK	99,76	988,71	751,05	106 442,84
	SUB-TOTAL						106 442,84
123	Obrigações diversas						
	OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	2 000,00	EUR	100,00	100,00	14,47	2 014,47
	SUB-TOTAL						2 014,47
3	U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31	Fundos harmonizados						
	BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 917,47	EUR	167,00	167,00		487 217,99
	Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	502,87	EUR	137,49	137,49		69 139,60
	Bluebay GLB SOV OPP-M EUR	791,73	EUR	96,90	96,90		76 718,44
	CANDRIAM Euro High Yield	139,69	EUR	1 175,98	1 175,98		164 269,12
	COBAS Lux SICAV Global Fund	2,25	EUR	14 979,51	14 979,51		33 696,41
	Candriam Long Short Global Credit	743,89	EUR	102,49	102,49		76 241,18
	Central Fund Canada LTD	8 763,00	USD	12,54	14,38		95 844,33
	ETF WTI CRUDE OIL (EUR)	3 739,00	EUR	5,84	5,84		21 835,76
	ETFS 5x Short USD Long EUR	3 266,00	EUR	11,26	11,26		36 762,10
	ETFS AGRICULTURE	5 629,00	EUR	3,60	3,60		20 270,03
	ETFS Copper	1 339,00	EUR	21,62	21,62		28 949,18
	FISHER EMERGING MARKETS EQ-EUR UH	508,16	EUR	117,22	117,22		59 566,87
	FUNDSMITH Equity Fund	4 530,43	EUR	32,12	32,12		145 517,41
	First Trust Eurozone ALPHADX	843,00	EUR	27,08	27,08		22 824,23
	GROUPAMA Enterprises - IC	66,89	EUR	2 276,11	2 276,11		152 251,73
	GROUPAMA Trésorerie IC	3,08	EUR	40 261,52	40 261,52		124 186,66
	H2O MODERATO-IC	1,32	EUR	88 689,38	88 689,38		117 007,90
	HENDERSON Horizon Pan-European Alpha	4 504,82	EUR	15,75	15,75		70 950,85
	INRIS UCITS R Parus I EUR HD	712,35	EUR	105,59	105,59		75 217,35
	INVESCO Pan European Structured Equity	5 173,79	EUR	12,25	12,25		63 378,93
	ISHARES MSCI Emerging Markets ETF	627,00	USD	39,06	44,78		21 360,72
	ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	858,00	EUR	43,20	43,20		37 065,60
	ISHARES S&P 500 EUR	467,00	EUR	56,05	56,05		26 176,28
	Ishares NASDAQ 100 USD	49,00	EUR	309,40	309,40		15 160,60
	JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	22 848,11	EUR	12,58	12,58		287 429,22
	Jupiter Dynamic Bond Fund	8 367,00	EUR	10,32	10,32		86 347,44
	KEMPEN Euro Credit	156,60	EUR	1 392,64	1 392,64		218 087,42
	L&G Emerging Markets Short Duration	132 625,51	EUR	0,96	0,96		127 718,36
	La Française Euro Inflation	153,27	EUR	1 716,62	1 716,62		263 107,03
	Lindsell Train - GL-Equity EUR	110 774,36	EUR	1,08	1,08		120 079,41
	Lyxor BTP 10Y	489,00	EUR	132,77	132,77		64 924,53
	Lyxor Bund 1X Inverse	5 249,00	EUR	46,26	46,26		242 792,50
	M&G Optimal Income Fd C-H	16 345,99	EUR	20,50	20,50		335 027,47
	MAN GLG European Inc Opportunities	820,20	EUR	87,40	87,40		71 685,57

	MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I	23,26	EUR	1 126,97	1 126,97	26 213,05
	ML AQR Global Relative Value	589,84	EUR	101,59	101,59	59 921,44
	Merrill Lynch Inv.Sol.-Marshall Wace TOPS	550,97	EUR	136,63	136,63	75 279,58
	NATIXIS TRESORERIE - IC	13,06	EUR	12 501,72	12 501,72	163 234,96
	ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	705,56	EUR	31,53	31,53	22 246,21
	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	1 727,00	USD	12,94	14,84	19 491,38
	PIMCO FD-LD GLB IGR C- IEURHA	27 616,71	EUR	10,39	10,39	286 937,60
	PIMCO GIS-INCOME FD (INST)	21 398,01	EUR	13,37	13,37	286 091,34
	ROBECO BP US PREM EQ.-IHEUR	210,93	EUR	214,47	214,47	45 237,92
	STEWART Investors Asia Pacific Leaders	12 580,02	EUR	2,23	2,23	28 053,45
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	1 839,00	USD	14,00	16,05	22 455,66
	VECTOR FUND - NAVIGATOR -I1	103,69	EUR	1 502,48	1 502,48	155 786,14
	Vaneck Vectors Gold Miners	1 784,00	USD	21,09	24,18	32 816,14
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 579,06	EUR	105,41	105,41	166 448,71
	Winton Diversified Fund UC- EUR	802,08	EUR	103,35	103,35	82 894,66
	SUB-TOTAL					5 331 916,46
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	16,69	16,69	245 972,32
	IMOSOCIAL	285,00	EUR	0,08	0,08	23,57
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	421,00	EUR	11,70	11,70	4 925,70
	SEB Immoinvest	729,00	EUR	5,54	5,54	4 035,02
	SUB-TOTAL					254 956,61
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			12 825,84
	BBVA-USD		USD			9,93
	CGD-EUR		EUR			156 772,09
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			25,49
	Millenium USD		USD			-0,01
	Millenium bcp		EUR			143 991,66
	SUB-TOTAL					313 625,00
9	Outros valores a regularizar		EUR			6 393,18
	TOTAL DE APLICAÇÕES					6 067 675,23
	TOTAL DO FUNDO					6 074 068,41

Lisboa, 31 de Dezembro de 2018