

FUNDO DE PENSÕES ABERTO - SGF EMPRESAS PRUDENTE

Valor Patrimonial Unitário em 31/07/2019 5,74514 EUR
N.º Unidades de Participação em circulação 1 134 879

	Quantidade	Moeda	Cot. Moeda	Cot. Euro	Jur Dec	Valor (Euro)
1 Valores mobiliários cotados						
11 Mercado cot. ofic. de B.V. Port.						
114 Acções						
BES	35 430,00	EUR				0,00
12 Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE						
121 Títulos de dívida pública						
EIB FLOAT 01/10/2022 GBP	60 000,00	GBP	100,17	91,26	37,48	66 004,78
SUB-TOTAL						66 004,78
122 Outros fundos públicos e equiparados						
EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	1 250 000,00	NOK	99,80	980,35	301,18	127 296,68
SUB-TOTAL						127 296,68
123 Obrigações diversas						
OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	2 000,00	EUR	100,00	100,00	31,80	2 031,80
SUB-TOTAL						2 031,80
124 Acções						
ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	5 161,00	EUR	8,38	8,38		43 249,18
SUB-TOTAL						43 249,18
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 917,47	EUR	181,44	181,44		529 346,30
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	502,87	EUR	139,49	139,49		70 145,34
Bluebay GLB SOV OPP-M EUR	760,39	EUR	99,43	99,43		75 605,38
CANDRIAM Euro High Yield	139,69	EUR	1 272,50	1 272,50		177 751,71
COBAS Lux SICAV Global Fund	2,25	EUR	15 009,35	15 009,35		33 763,53
Candriam Long Short Global Credit	743,89	EUR	103,39	103,39		76 910,68
Central Fund Canada LTD	8 763,00	USD	13,61	15,08		107 660,00
ETF WTI CRUDE OIL (EUR)	3 739,00	EUR	7,65	7,65		28 592,13
ETFS 5x Short USD Long EUR	3 266,00	EUR	8,62	8,62		28 162,72
ETFS AGRICULTURE	5 629,00	EUR	3,53	3,53		19 861,93
ETFS Copper	1 339,00	EUR	22,17	22,17		29 678,94
FISHER EMERGING MARKETS EQ-EUR UH	508,16	EUR	134,29	134,29		68 241,21
FUNDSMITH Equity Fund	4 479,42	EUR	40,98	40,98		183 571,56
First Trust Eurozone ALPHADX	843,00	EUR	31,02	31,02		26 145,65
GROUPAMA Enterprises - IC	66,89	EUR	2 273,24	2 273,24		152 059,75
GROUPAMA Trésorerie IC	3,08	EUR	40 229,05	40 229,05		124 086,50
HENDERSON Horizon Pan-European Alpha	4 878,19	EUR	16,43	16,43		80 148,60
INRIS UCITS R Parus I EUR HD	692,60	EUR	101,87	101,87		70 555,47
INVESCO Pan European Structured Equity	5 026,30	EUR	13,71	13,71		68 910,57
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	1 049,00	EUR	45,81	45,81		48 054,69
Ishares MSCI Emerging Markets USD	1 631,00	EUR	29,76	29,76		48 538,56
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	23 540,42	EUR	13,41	13,41		315 677,03
Jupiter Dynamic Bond Fund	5 146,00	EUR	10,80	10,80		55 576,80
KEMPEN Euro Credit	156,60	EUR	1 493,39	1 493,39		233 864,87
L&G Emerging Markets Short Duration	132 625,51	EUR	1,03	1,03		136 697,11
La Française Euro Inflation	162,13	EUR	1 789,86	1 789,86		290 190,72
Lindsell Train - GL-Equity EUR	147 155,75	EUR	1,35	1,35		198 351,23
Lyxor Bund 1X Inverse	8 742,00	EUR	42,91	42,91		375 119,22
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	33 628,98	EUR	10,36	10,36		348 483,67

	MAN GLG European Inc Opportunities	799,31	EUR	98,59	98,59	78 804,07
	MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I	25,61	EUR	1 176,59	1 176,59	30 135,94
	Merrill Lynch Inv.Sol.-Marshall Wace TOPS	594,20	EUR	138,34	138,34	82 202,18
	NATIXIS TRESORERIE - IC	13,06	EUR	12 482,97	12 482,97	162 990,14
	ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	705,56	EUR	32,88	32,88	23 198,71
	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	1 727,00	USD	18,08	20,03	28 186,05
	PIMCO FD-LD GLB IGR C- IEURHA	29 225,04	EUR	10,69	10,69	312 415,66
	PIMCO GIS-INCOME FD (INST)	22 413,98	EUR	14,03	14,03	314 468,08
	Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	20 322,82	EUR	2,36	2,36	47 961,84
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	1 839,00	USD	14,68	16,26	24 361,46
	US NATURAL GAS FUND LP	1 418,00	USD	19,44	21,54	24 883,76
	VECTOR FUND - NAVIGATOR -I1	102,50	EUR	1 780,14	1 780,14	182 457,23
	Vaneck Vectors Gold Miners	1 784,00	USD	26,50	29,36	42 676,05
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 662,94	EUR	108,56	108,56	180 528,77
	Winton Diversified Fund UC- EUR	802,08	EUR	104,13	104,13	83 517,07
	iShares \$ TreasuryBond 1-3yr UCITS ETF USD (Acc) B	1 966,00	USD	109,96	121,81	195 146,91
	iShares J.P.Morgan \$EMBond EUR Hgd UCITS ETF(Dist)	1 209,00	EUR	95,54	95,54	115 505,08
	SUB-TOTAL					5 931 190,87
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	17,20	17,20	253 408,61
	IMOSOCIAL	285,00	EUR	0,05	0,05	13,11
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	421,00	EUR	9,13	9,13	3 843,73
	SEB Immoinvest	729,00	EUR	4,51	4,51	3 287,79
	SUB-TOTAL					260 553,24
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			19 542,06
	BBVA-USD		USD			10,27
	BIG - Banco de Investimento Global		EUR			196 924,99
	BIG GBP		GBP			271,24
	BIG USD		USD			15 942,12
	CGD-EUR		EUR			49 670,19
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			25,49
	Millenium bcp		EUR			21 187,43
	SUB-TOTAL					303 573,79
52	A prazo					
521	Depósitos e outros equiparados					
9	Outros valores a regularizar	52 000,00	EUR			-213 989,34
	TOTAL DE APLICAÇÕES					6 734 024,85
	TOTAL DO FUNDO					6 520 035,51

Lisboa, 31 de Julho de 2019