

FUNDO DE PENSÕES ABERTO - SGF EMPRESAS PRUDENTE

Valor Patrimonial Unitário em 31/05/2019 5,65114 EUR
N.º Unidades de Participação em circulação 1 137 952

	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						
122 Outros fundos públicos e equiparados						
EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	1 250 000,00	NOK	99,79	977,36	62,77	127 417,21
SUB-TOTAL						127 417,21
123 Obrigações diversas						
OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	2 000,00	EUR	100,00	100,00	26,88	2 026,88
SUB-TOTAL						2 026,88
124 Acções						
ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	5 161,00	EUR	8,89	8,89		45 881,29
SUB-TOTAL						45 881,29
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 917,47	EUR	172,75	172,75		503 993,46
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	502,87	EUR	140,97	140,97		70 889,58
Bluebay GLB SOV OPP-M EUR	760,39	EUR	95,55	95,55		72 655,07
CANDRIAM Euro High Yield	139,69	EUR	1 241,70	1 241,70		173 449,35
COBAS Lux SICAV Global Fund	2,25	EUR	15 509,30	15 509,30		34 888,17
Candriam Long Short Global Credit	743,89	EUR	102,94	102,94		76 575,93
Central Fund Canada LTD	8 763,00	USD	12,38	13,85		96 986,43
ETF WTI CRUDE OIL (EUR)	3 739,00	EUR	7,27	7,27		27 197,49
ETFS 5x Short USD Long EUR	3 266,00	EUR	9,03	9,03		29 482,18
ETFS AGRICULTURE	5 629,00	EUR	3,69	3,69		20 796,34
ETFS Copper	1 339,00	EUR	21,99	21,99		29 437,92
FISHER EMERGING MARKETS EQ-EUR UH	508,16	EUR	124,71	124,71		63 373,01
FUNDSMITH Equity Fund	4 479,42	EUR	38,83	38,83		173 935,88
First Trust Eurozone ALPHADX	843,00	EUR	29,56	29,56		24 918,24
GROUPAMA Enterprises - IC	66,89	EUR	2 274,05	2 274,05		152 113,93
GROUPAMA Trésorerie IC	3,08	EUR	40 233,02	40 233,02		124 098,75
H2O MODERATO-IC	1,29	EUR	90 641,76	90 641,76		116 864,42
HENDERSON Horizon Pan-European Alpha	4 504,82	EUR	15,95	15,95		71 851,82
INRIS UCITS R Parus I EUR HD	692,60	EUR	101,76	101,76		70 479,28
INVESCO Pan European Structured Equity	5 026,30	EUR	13,23	13,23		66 497,95
ISHARES MSCI Emerging Markets ETF	414,00	USD	40,71	45,54		15 067,42
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	1 049,00	EUR	44,73	44,73		46 923,13
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	23 540,42	EUR	13,27	13,27		312 381,37
Jupiter Dynamic Bond Fund	5 146,00	EUR	10,79	10,79		55 525,34
KEMPEN Euro Credit	156,60	EUR	1 449,56	1 449,56		227 001,10
L&G Emerging Markets Short Duration	132 625,51	EUR	1,01	1,01		133 341,68
La Française Euro Inflation	153,27	EUR	1 701,91	1 701,91		260 852,43
Lindsell Train - GL-Equity EUR	147 155,75	EUR	1,30	1,30		191 567,35
Lyxor Bund 1X Inverse	8 512,00	EUR	44,15	44,15		375 782,67
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	33 628,98	EUR	10,12	10,12		340 325,28
MAN GLG European Inc Opportunities	799,31	EUR	95,78	95,78		76 558,01
MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I	25,61	EUR	1 155,83	1 155,83		29 604,14
Merrill Lynch Inv.Sol.-Marshall Wace TOPS	550,97	EUR	139,26	139,26		76 728,64
NATIXIS TRESORERIE - IC	13,06	EUR	12 488,10	12 488,10		163 057,12

	ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	705,56	EUR	31,26	31,26	22 055,71
	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	1 727,00	USD	16,62	18,59	25 660,25
	PIMCO FD-LD GLB IGR C- IEURHA	29 225,04	EUR	10,60	10,60	309 785,40
	PIMCO GIS-INCOME FD (INST)	22 413,98	EUR	13,86	13,86	310 657,71
	Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	20 322,82	EUR	2,32	2,32	47 148,93
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	1 839,00	USD	14,80	16,55	24 332,18
	US NATURAL GAS FUND LP	1 418,00	USD	21,05	23,55	26 684,92
	VECTOR FUND - NAVIGATOR -I1	102,50	EUR	1 660,02	1 660,02	170 145,41
	Vaneck Vectors Gold Miners	1 784,00	USD	21,59	24,15	34 433,80
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 662,94	EUR	107,42	107,42	178 633,01
	Winton Diversified Fund UC- EUR	802,08	EUR	104,10	104,10	83 495,41
	SUB-TOTAL					5 538 233,61
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	16,99	16,99	250 406,68
	IMOSOCIAL	285,00	EUR	0,08	0,08	23,54
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	421,00	EUR	9,15	9,15	3 852,15
	SEB Immoinvest	729,00	EUR	5,07	5,07	3 696,76
	SUB-TOTAL					257 979,13
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			23 104,75
	BBVA-USD		USD			10,17
	BIG - Banco de Investimento Global		EUR			131 659,35
	CGD-EUR		EUR			284 567,11
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			25,49
	Millenium bcp		EUR			30 492,68
	Millennium NOK		NOK			1 206,06
	SUB-TOTAL					471 065,61
52	A prazo					
521	Depósitos e outros equiparados					
9	Outros valores a regularizar	52 000,00	EUR			-12 000,16
	TOTAL DE APLICAÇÕES					6 442 728,24
	TOTAL DO FUNDO					6 430 728,08

Lisboa, 31 de Maio de 2019