

FUNDO DE PENSÕES ABERTO - SGF EMPRESAS PRUDENTE

Valor Patrimonial Unitário em 31/03/2019 5,67421 EUR
N.º Unidades de Participação em circulação 1 143 112

	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	1 050 000,00	NOK	99,84	966,52	1 069,79	109 363,42
SUB-TOTAL						109 363,42
123 Obrigações diversas						
OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	2 000,00	EUR	100,00	100,00	21,86	2 021,86
SUB-TOTAL						2 021,86
124 Acções						
ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	1 672,00	EUR	9,09	9,09		15 198,48
SUB-TOTAL						15 198,48
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 917,47	EUR	171,19	171,19		499 442,20
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	502,87	EUR	139,04	139,04		69 919,04
Bluebay GLB SOV OPP-M EUR	791,73	EUR	95,84	95,84		75 879,21
CANDRIAM Euro High Yield	139,69	EUR	1 230,44	1 230,44		171 876,47
COBAS Lux SICAV Global Fund	2,25	EUR	16 474,16	16 474,16		37 058,62
Candriam Long Short Global Credit	743,89	EUR	102,85	102,85		76 508,98
Central Fund Canada LTD	8 763,00	USD	12,40	13,91		96 849,73
ETF WTI CRUDE OIL (EUR)	3 739,00	EUR	7,83	7,83		29 283,85
ETFS 5x Short USD Long EUR	3 266,00	EUR	9,68	9,68		31 611,61
ETFS AGRICULTURE	5 629,00	EUR	3,54	3,54		19 946,36
ETFS Copper	1 339,00	EUR	24,17	24,17		32 363,63
FISHER EMERGING MARKETS EQ-EUR UH	508,16	EUR	131,52	131,52		66 833,60
FUNDSMITH Equity Fund	4 530,43	EUR	38,62	38,62		174 979,25
First Trust Eurozone ALPHADX	843,00	EUR	30,20	30,20		25 454,39
GROUPAMA Enterprises - IC	66,89	EUR	2 274,93	2 274,93		152 172,80
GROUPAMA Trésorerie IC	3,08	EUR	40 243,92	40 243,92		124 132,37
H2O MODERATO-IC	1,32	EUR	89 826,42	89 826,42		118 508,00
HENDERSON Horizon Pan-European Alpha	4 504,82	EUR	16,14	16,14		72 707,73
INRIS UCITS R Parus I EUR HD	712,35	EUR	101,67	101,67		72 424,93
INVESCO Pan European Structured Equity	5 173,79	EUR	13,54	13,54		70 053,12
ISHARES MSCI Emerging Markets ETF	414,00	USD	42,92	48,15		15 837,40
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	858,00	EUR	46,31	46,31		39 737,15
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	22 848,11	EUR	13,04	13,04		297 939,35
Jupiter Dynamic Bond Fund	5 146,00	EUR	10,60	10,60		54 547,60
KEMPEN Euro Credit	156,60	EUR	1 438,34	1 438,34		225 244,04
L&G Emerging Markets Short Duration	132 625,51	EUR	1,00	1,00		132 466,36
La Française Euro Inflation	153,27	EUR	1 705,82	1 705,82		261 451,71
Lindsell Train - GL-Equity EUR	148 673,66	EUR	1,26	1,26		187 061,19
Lyxor Bund 1X Inverse	6 573,00	EUR	44,64	44,64		293 420,69
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	32 643,76	EUR	10,16	10,16		331 536,56
MAN GLG European Inc Opportunities	820,20	EUR	97,83	97,83		80 240,26
MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I	23,26	EUR	1 260,19	1 260,19		29 311,63
Merrill Lynch Inv.Sol.-Marshall Wace TOPS	550,97	EUR	139,30	139,30		76 750,68

	NATIXIS TRESORERIE - IC	13,06	EUR	12 493,55	12 493,55	163 128,28
	ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	705,56	EUR	32,39	32,39	22 852,99
	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	1 727,00	USD	17,20	19,30	26 475,53
	PIMCO FD-LD GLB IGR C- IEURHA	27 616,71	EUR	10,57	10,57	291 908,60
	PIMCO GIS-INCOME FD (INST)	21 398,01	EUR	13,76	13,76	294 436,56
	Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	20 322,82	EUR	2,33	2,33	47 352,16
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	1 839,00	USD	14,90	16,72	24 422,60
	US NATURAL GAS FUND LP	1 418,00	USD	23,48	26,34	29 675,51
	VECTOR FUND - NAVIGATOR -I1	103,69	EUR	1 684,71	1 684,71	174 680,84
	Vaneck Vectors Gold Miners	1 784,00	USD	22,42	25,15	35 649,58
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 579,06	EUR	107,18	107,18	169 243,65
	Winton Diversified Fund UC- EUR	802,08	EUR	102,57	102,57	82 265,83
	SUB-TOTAL					5 405 642,64
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	16,84	16,84	248 197,61
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	421,00	EUR	11,67	11,67	4 913,07
	SEB Immoinvest	729,00	EUR	5,36	5,36	3 907,44
	SUB-TOTAL					257 018,12
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			20 147,82
	BBVA-USD		USD			10,14
	BIG - Banco de Investimento Global		EUR			235 440,11
	CGD-EUR		EUR			345 980,50
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			25,49
	Millenium bcp		EUR			107 453,30
	SUB-TOTAL					709 057,36
52	A prazo					
521	Depósitos e outros equiparados					
9	Outros valores a regularizar	52 000,00	EUR			-12 174,54
	TOTAL DE APLICAÇÕES					6 498 426,39
	TOTAL DO FUNDO					6 486 251,85

Lisboa, 31 de Março de 2019