

FUNDO DE PENSÕES ABERTO - SGF EMPRESAS PRUDENTE

		Valor Patrimonial Unitário em 31/08/2018		5,67646 EUR			
		N.º Unidades de Participação em circulação		1 105 334			
		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						
	UK TSY 1,75% 22/07/2019	52 000,00	GBP	100,90	90,33	111,40	58 719,32
	SUB-TOTAL						58 719,32
122	Outros fundos públicos e equiparados						
	EIB 0% 27/08/2021	340 000,00	BRL	78,33	368,49		56 606,51
	EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	1 050 000,00	NOK	99,87	971,48	359,31	108 156,83
	SUB-TOTAL						164 763,34
123	Obrigações diversas						
	OREY Best Of 2027 (ex-2018, ex-2021)	2 000,00	EUR	100,00	100,00	4,44	2 004,44
	SUB-TOTAL						2 004,44
3	U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31	Fundos harmonizados						
	AXA Global Inflation Short Duration	2 688,21	EUR	99,37	99,37		267 127,13
	BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 917,47	EUR	165,74	165,74		483 541,98
	Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	502,87	EUR	136,62	136,62		68 702,10
	Bluebay GLB SOV OPP-M EUR	791,73	EUR	104,58	104,58		82 798,91
	CANDRIAM Euro High Yield	139,69	EUR	1 204,31	1 204,31		168 226,45
	COBAS Lux SICAV Global Fund	14,13	EUR	19 160,52	19 160,52		270 759,22
	Candriam Long Short Global Credit	743,89	EUR	102,78	102,78		76 456,91
	Central Fund Canada LTD	5 778,00	USD	11,75	13,63		58 522,47
	ETFS AGRICULTURE	5 629,00	EUR	3,59	3,59		20 182,78
	ETFS Copper	1 339,00	EUR	21,33	21,33		28 554,18
	FISHER EMERGING MARKETS EQ-EUR UH	396,05	EUR	129,28	129,28		51 200,96
	FUNDSMITH Equity Fund	4 216,73	EUR	35,53	35,53		149 820,42
	First Trust Eurozone ALPHADX	843,00	EUR	32,68	32,68		27 549,24
	GROUPAMA Enterprises - IC	66,89	EUR	2 278,26	2 278,26		152 395,55
	GROUPAMA Trésorerie IC	6,13	EUR	40 294,38	40 294,38		247 185,87
	H2O MODERATO-IC	1,32	EUR	80 746,66	80 746,66		106 529,07
	HENDERSON Horizon Pan-European Alpha	4 504,82	EUR	16,70	16,70		75 230,43
	INRIS UCITS R Parus I EUR HD	712,35	EUR	106,68	106,68		75 993,82
	INVESCO Pan European Structured Equity	5 173,79	EUR	14,02	14,02		72 536,54
	ISHARES MSCI Emerging Markets ETF	320,00	USD	43,17	50,08		11 908,01
	ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	858,00	EUR	49,55	49,55		42 513,90
	ISHARES S&P 500 EUR	467,00	EUR	65,09	65,09		30 396,56
	JP MORGAN Global Corporate Bond	483,60	EUR	95,91	95,91		46 382,17
	JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	22 848,11	EUR	12,67	12,67		289 485,55
	Jupiter Dynamic Bond Fund	8 367,00	EUR	10,61	10,61		88 773,87
	KEMPEN Euro Credit	125,84	EUR	1 402,17	1 402,17		176 449,07
	L&G Emerging Markets Short Duration	132 625,51	EUR	0,96	0,96		127 426,59
	Lyxor BTP 10Y	489,00	EUR	124,82	124,82		61 036,98
	Lyxor Bund 1X Inverse	2 667,00	EUR	46,95	46,95		125 223,65
	M&G Optimal Income Fd C-H	14 921,20	EUR	21,06	21,06		314 191,25
	MAN GLG European Inc Opportunities	820,20	EUR	100,01	100,01		82 028,30
	MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I	23,26	EUR	1 260,85	1 260,85		29 327,01
	ML AQR Global Relative Value	589,84	EUR	106,87	106,87		63 035,77

	Merrill Lynch Inv.Sol.-Marshall Wace TOPS	550,97	EUR	145,88	145,88	80 376,09
	NATIXIS TRESORERIE - IC	13,06	EUR	12 513,37	12 513,37	163 387,07
	ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	705,56	EUR	35,34	35,34	24 934,38
	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	1 727,00	USD	15,36	17,82	22 866,03
	PIMCO FD-LD GLB IGR C- IEURHA	27 616,71	EUR	10,45	10,45	288 594,60
	PIMCO GIS-INCOME FD (INST)	21 398,01	EUR	13,39	13,39	286 519,30
	ROBECO BP GLOBAL PREMIUM EQUITIES IH EUR	239,46	EUR	114,96	114,96	27 528,10
	ROBECO BP US PREM EQ.-IHEUR	210,93	EUR	262,72	262,72	55 415,24
	STEWART Investors Asia Pacific Leaders	12 580,02	EUR	2,32	2,32	29 159,23
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	1 839,00	USD	15,80	18,33	25 046,44
	US NATURAL GAS FUND LP	1 605,00	USD	23,95	27,78	33 135,06
	VECTOR FUND - NAVIGATOR -I1	105,04	EUR	1 755,64	1 755,64	184 417,69
	Vaneck Vectors Gold Miners	2 391,00	USD	18,55	21,52	38 232,33
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 579,06	EUR	106,75	106,75	168 564,66
	Winton Diversified Fund UC- EUR	802,08	EUR	105,90	105,90	84 936,75
	SUB-TOTAL					5 484 605,68
32	Fundos não harmonizados					
	BANIF Global Private Equity Fund - FCR	666,67	EUR	0,17	0,17	116,54
	SUB-TOTAL					116,54
4	Imobiliário					
42	U. P.'s de fundos de investimento imobiliário					
	CA Património Crescente	12 598,00	EUR	16,36	16,36	206 044,07
	IMOSOCIAL	285,00	EUR	3,20	3,20	911,86
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	421,00	EUR	15,31	15,31	6 445,51
	SEB Immoinvest	729,00	EUR	5,09	5,09	3 709,15
	SUB-TOTAL					217 110,59
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			3 700,10
	BBVA-USD		USD			9,81
	CGD-EUR		EUR			266 552,90
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			25,49
	Millenium bcp		EUR			403 202,97
	SUB-TOTAL					673 491,27
52	A prazo					
521	Depósitos e outros equiparados					
9	Outros valores a regularizar	52 000,00	EUR			-326 430,67
	TOTAL DE APLICAÇÕES					6 600 811,18
	TOTAL DO FUNDO					6 274 380,51

Lisboa, 31 de Agosto de 2018