

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA  
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR  
 Composição da Carteira em 2018-07-31

| Designação                              | Quantidade | Preço Unit. | Mda | Preço Unit.<br>(EUR) | Juro Corrido<br>(EUR) | Valor Total<br>(EUR) |
|---|------------|-------------|-----|----------------------|-----------------------|----------------------|
| <b>COMPOSIÇÃO DISCRIMINADA CARTEIRA</b> |            |             |     |                      |                       |                      |
| <b>VALORES MOBILIÁRIOS COTADOS</b>      |            |             |     |                      |                       |                      |
| Merc. Cot. Oficiais de Bolsa Val. Port. |            |             |     |                      | 635                   | 143 444              |
| Titulos de Dívida Pública               |            |             |     |                      |                       |                      |
| PGB 2.25% 04/34                         | 86 000     | 99.66%      | EUR | 99.66%               | 557                   | 86 265               |
| Obrigações diversas                     |            |             |     |                      |                       |                      |
| RENEPL Float 20                         | 40 000     | 103.19%     | EUR | 103.19%              | 79                    | 41 355               |
| Acções                                  |            |             |     |                      |                       |                      |
| EDP Renováveis                          | 1 792      | 8.83        | EUR | 8.83                 |                       | 15 823               |
| Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE |            |             |     |                      | 54 959                | 11 887 857           |
| Titulos de Dívida Pública               |            |             |     |                      |                       |                      |
| DBR 6.25% 01/2024                       | 230 000    | 134.65%     | EUR | 134.65%              | 8 231                 | 317 919              |
| DBR 5.5% 01/04/31                       | 140 000    | 159.60%     | EUR | 159.60%              | 4 409                 | 227 848              |
| DBR 4% 04/01/37                         | 300 000    | 154.45%     | EUR | 154.45%              | 6 871                 | 470 212              |
| DBR 3.25% 01/2020                       | 790 000    | 105.59%     | EUR | 105.59%              | 14 702                | 848 855              |
| DBR 2.5% 07/2044                        | 197 000    | 133.90%     | EUR | 133.90%              | 378                   | 264 157              |
| DBR 1.5% 02/2023                        | 45 000     | 108.04%     | EUR | 108.04%              | 309                   | 48 927               |
| DBR 1.75% 2/2024                        | 130 000    | 110.35%     | EUR | 110.35%              | 1 041                 | 144 492              |
| BKO 0% 09/18                            | 500 000    | 100.01%     | EUR | 100.01%              |                       | 500 035              |
| FRTR 4.5% 04/2041                       | 130 000    | 161.21%     | EUR | 161.21%              | 1 571                 | 211 141              |
| FRTR 3.25% 5/2045                       | 30 000     | 138.68%     | EUR | 138.68%              | 182                   | 41 784               |
| SPGB 4.8% 01/2024                       | 105 000    | 123.25%     | EUR | 123.25%              | 2 513                 | 131 925              |
| SPGB 4.6% 07/2019                       | 190 000    | 105.02%     | EUR | 105.02%              | 48                    | 199 592              |
| SPGB 4.7% 07/2041                       | 50 000     | 144.67%     | EUR | 144.67%              | 13                    | 72 348               |
| SPGB 3.45% 07/66                        | 51 000     | 118.42%     | EUR | 118.42%              | 10                    | 60 404               |
| SPGB 0.45% 10/22                        | 286 000    | 101.25%     | EUR | 101.25%              | 966                   | 290 547              |
| BTPS 4% 2/2037                          | 170 000    | 111.45%     | EUR | 111.45%              | 3 400                 | 192 857              |
| BTPS 4.75% 08/2023                      | 80 000     | 113.51%     | EUR | 113.51%              | 1 900                 | 92 704               |
| BTPS 4.25% 09/2019                      | 5 000      | 104.15%     | EUR | 104.15%              | 88                    | 5 296                |
| BTPS 4.5% 05/2023                       | 108 000    | 111.98%     | EUR | 111.98%              | 1 215                 | 122 149              |
| BTPS 4.5% 03/2024                       | 90 000     | 112.48%     | EUR | 112.48%              | 1 684                 | 102 919              |
| SPGB 6% 31/01/2029                      | 80 000     | 144.81%     | EUR | 144.81%              | 2 393                 | 118 241              |
|   |            |             |     |                      |                       | 4 464 351            |
| Outros Fundos Públicos e Equiparados    |            |             |     |                      |                       |                      |
| BERGER Float 10/22                      | 50 000     | 102.45%     | EUR | 102.45%              | 2                     | 51 229               |
| Obrigações diversas                     |            |             |     |                      |                       |                      |
| DAIGR Float 07/24                       | 100 000    | 99.13%      | EUR | 99.13%               | 10                    | 99 139               |
| BASGR Float 11/19                       | 100 000    | 100.30%     | EUR | 100.30%              |                       | 100 301              |
| SAPGR Float 03/21                       | 100 000    | 100.44%     | EUR | 100.44%              |                       | 100 443              |
| ACAFP Float 04/22                       | 100 000    | 100.66%     | EUR | 100.66%              | 16                    | 100 674              |
| MCFP Float 11/18                        | 60 000     | 100.07%     | EUR | 100.07%              |                       | 60 043               |
| BNP Float 06/24                         | 100 000    | 100.38%     | EUR | 100.38%              | 65                    | 100 445              |
| RENAUL Float 03/2022                    | 100 000    | 100.03%     | EUR | 100.03%              | 47                    | 100 079              |
| RENAULT Float 11/24                     | 50 000     | 98.48%      | EUR | 98.48%               | 30                    | 49 272               |
| ALDFP Float 11/20                       | 100 000    | 100.00%     | EUR | 100.00%              | 19                    | 100 021              |

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA  
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR  
Composição da Carteira em 2018-07-31

| Designação           | Quantidade | Preço Unit. | Mda | Preço Unit.<br>(EUR) | Juro Corrido<br>(EUR) | Valor Total<br>(EUR) |
|----------------------|------------|-------------|-----|----------------------|-----------------------|----------------------|
| HSBC Float 09/22     | 100 000    | 100.63%     | EUR | 100.63%              | 37                    | 100 670              |
| LLOYDS Float 06/2024 | 100 000    | 100.02%     | EUR | 100.02%              | 52                    | 100 069              |
| HSBC 0.17% 10/23     | 100 000    | 99.81%      | EUR | 99.81%               | 13                    | 99 821               |
| SANTAN Float 03/22   | 100 000    | 101.10%     | EUR | 101.10%              | 79                    | 101 180              |
| BKTSM 1.25% 02/28    | 200 000    | 101.05%     | EUR | 101.05%              | 1 199                 | 203 301              |
| SCANIA Float 04/20   | 100 000    | 100.18%     | EUR | 100.18%              | 3                     | 100 184              |
| BAC Float 05/23      | 100 000    | 100.57%     | EUR | 100.57%              | 112                   | 100 684              |
| MS Float 11/22       | 100 000    | 100.28%     | EUR | 100.28%              | 88                    | 100 367              |
| GM Float 05/21       | 100 000    | 100.50%     | EUR | 100.50%              | 81                    | 100 582              |
| T Float 09/2023      | 100 000    | 100.97%     | EUR | 100.97%              | 85                    | 101 059              |
| MS Float 05/21       | 100 000    | 99.94%      | EUR | 99.94%               | 15                    | 99 954               |
| NDASS Float 09/21    | 100 000    | 100.87%     | EUR | 100.87%              | 17                    | 100 883              |
| MYL FLOAT 11/18      | 100 000    | 100.19%     | EUR | 100.19%              | 107                   | 100 299              |
| VW Float 03/19       | 100 000    | 100.09%     | EUR | 100.09%              | 2                     | 100 087              |
| ALVGR Float 12/20    | 200 000    | 100.96%     | EUR | 100.96%              | 54                    | 201 964              |
| DAIGR Float 04/20    | 100 000    | 100.45%     | EUR | 100.45%              | 11                    | 100 464              |
| NYKRE Float 06/22    | 100 000    | 99.94%      | EUR | 99.94%               | 40                    | 99 981               |
| CBSBKF Float 03/21   | 100 000    | 100.30%     | EUR | 100.30%              | 27                    | 100 322              |
| CCBGBB Float 09/2018 | 100 000    | 100.06%     | EUR | 100.06%              | 31                    | 100 093              |
| KBCBB Float 11/22    | 100 000    | 99.85%      | EUR | 99.85%               | 43                    | 99 889               |
| DLTAS 2008-1 A       | 71 925     | 99.49%      | EUR | 99.49%               | 3                     | 71 560               |
| SUMIBK Float 06/22   | 100 000    | 99.76%      | EUR | 99.76%               | 17                    | 99 778               |
| MIZUHO Float 04/23   | 100 000    | 100.03%     | EUR | 100.03%              | 11                    | 100 037              |
| BCHINA Float 11/20   | 100 000    | 99.90%      | EUR | 99.90%               | 28                    | 99 926               |
| CAFP Float 03/2020   | 100 000    | 100.36%     | EUR | 100.36%              | 22                    | 100 385              |
| SANTAN Float 03/2020 | 100 000    | 100.52%     | EUR | 100.52%              | 45                    | 100 562              |
| CBAAUFloat 01/2020   | 100 000    | 100.47%     | EUR | 100.47%              | 2                     | 100 472              |
| UPS Float 07/2020    | 100 000    | 100.59%     | EUR | 100.59%              | 5                     | 100 593              |
| DE Float 04/20       | 100 000    | 100.32%     | EUR | 100.32%              | 1                     | 100 324              |
| GS Float 07/2022     | 75 000     | 101.60%     | EUR | 101.60%              | 8                     | 76 208               |
| GS Float 29/05/2020  | 125 000    | 100.79%     | EUR | 100.79%              | 84                    | 126 069              |
| BAC Float 05/2019    | 100 000    | 100.71%     | EUR | 100.71%              | 274                   | 100 984              |
| SAPGR Float 04/2020  | 65 000     | 100.41%     | EUR | 100.41%              |                       | 65 265               |
| MMM Float 05/20      | 100 000    | 100.45%     | EUR | 100.45%              |                       | 100 448              |
| ANNGR Float 09/18    | 100 000    | 100.02%     | EUR | 100.02%              | 8                     | 100 027              |
| ARRFP Float 01/2020  | 100 000    | 100.73%     | EUR | 100.73%              | 31                    | 100 759              |
| POHBK Float 03/20    | 100 000    | 100.31%     | EUR | 100.31%              |                       | 100 312              |
| SKYLN Float 04/20    | 100 000    | 100.78%     | EUR | 100.78%              | 36                    | 100 820              |
| VOD Float 02/2019    | 100 000    | 100.46%     | EUR | 100.46%              | 118                   | 100 576              |
| RABOBK Float 05/2020 | 150 000    | 100.42%     | EUR | 100.42%              |                       | 150 636              |
| ISPIM Float 04/2019  | 100 000    | 100.18%     | EUR | 100.18%              | 30                    | 100 213              |
| GE Float 01/2020     | 100 000    | 100.25%     | EUR | 100.25%              | 1                     | 100 255              |
| GIS Float 01/2020    | 100 000    | 100.83%     | EUR | 100.83%              | 18                    | 100 846              |
| BMW Float 03/2019    | 100 000    | 100.17%     | EUR | 100.17%              | 7                     | 100 174              |
| MCD Float 08/2019    | 100 000    | 100.23%     | EUR | 100.23%              |                       | 100 233              |
|                      |            |             |     |                      |                       | 5 519 733            |

## CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-07-31

| Designação<br>Acções | Quantidade | Preço Unit. | Mda | Preço Unit.<br>(EUR) | Juro Corrido<br>(EUR) | Valor Total<br>(EUR) |
|----------------------|------------|-------------|-----|----------------------|-----------------------|----------------------|
| SIEMENS              | 678        | 120.76      | EUR | 120.76               |                       | 81 875               |
| ALLIANZ              | 77         | 189.14      | EUR | 189.14               |                       | 14 564               |
| E.ON AG(EX VEBAG)    | 1 179      | 9.64        | EUR | 9.64                 |                       | 11 370               |
| BASF                 | 414        | 82.16       | EUR | 82.16                |                       | 34 014               |
| BAYER AG             | 439        | 95.26       | EUR | 95.26                |                       | 41 819               |
| ADIDAS- SALOMON AG   | 168        | 189.15      | EUR | 189.15               |                       | 31 777               |
| SAP SE               | 297        | 99.85       | EUR | 99.85                |                       | 29 655               |
| DEUTSCHE TELEKOM     | 1 390      | 14.15       | EUR | 14.15                |                       | 19 669               |
| DAIMLER CHRYSLER     | 286        | 59.15       | EUR | 59.15                |                       | 16 917               |
| INFINEON TECHNOLOGIE | 1 480      | 22.66       | EUR | 22.66                |                       | 33 537               |
| VOLKSWAGEN AG-PREF.  | 372        | 152.22      | EUR | 152.22               |                       | 56 626               |
| LEONI AG             | 749        | 43.57       | EUR | 43.57                |                       | 32 634               |
| FRESENIUS SE&CO KGAA | 535        | 66.02       | EUR | 66.02                |                       | 35 321               |
| COVESTRO AG          | 177        | 82.10       | EUR | 82.10                |                       | 14 532               |
| DANONE               | 567        | 67.21       | EUR | 67.21                |                       | 38 108               |
| PERNOD RICARD        | 70         | 137.95      | EUR | 137.95               |                       | 9 657                |
| TOTAL SA             | 1 607      | 55.86       | EUR | 55.86                |                       | 89 767               |
| Kering               | 81         | 456.00      | EUR | 456.00               |                       | 36 936               |
| PEUGEOT CITROEN      | 1 928      | 24.61       | EUR | 24.61                |                       | 47 448               |
| BNP                  | 154        | 55.67       | EUR | 55.67                |                       | 8 573                |
| AIR LIQUIDE          | 209        | 109.50      | EUR | 109.50               |                       | 22 886               |
| SCHNEIDER            | 161        | 68.84       | EUR | 68.84                |                       | 11 083               |
| L.V.M.H.             | 226        | 298.85      | EUR | 298.85               |                       | 67 540               |
| ORANGE               | 2 372      | 14.62       | EUR | 14.62                |                       | 34 667               |
| GLE ENTREP. VINCI    | 156        | 86.00       | EUR | 86.00                |                       | 13 416               |
| SANOFI SYNHLABO      | 243        | 74.37       | EUR | 74.37                |                       | 18 072               |
| AIRBUS SE            | 473        | 106.00      | EUR | 106.00               |                       | 50 138               |
| ARKEMA               | 96         | 107.25      | EUR | 107.25               |                       | 10 296               |
| SAFRAN SA            | 383        | 106.05      | EUR | 106.05               |                       | 40 617               |
| 3I GROUP             | 1 808      | 9.48        | GBP | 10.63                |                       | 19 212               |
| RECKITT BENCKISER    | 168        | 67.97       | GBP | 76.22                |                       | 12 805               |
| WEIR GROUP PLC       | 736        | 19.49       | GBP | 21.85                |                       | 16 082               |
| OCADO GROUP PLC      | 1 605      | 11.06       | GBP | 12.40                |                       | 19 906               |
| ADMIRAL GROUP PLC    | 1 581      | 19.81       | GBP | 22.21                |                       | 35 122               |
| ASHTED GROUP PLC     | 638        | 23.41       | GBP | 26.25                |                       | 16 749               |
| SHIRE PLC            | 571        | 43.51       | GBP | 48.79                |                       | 27 860               |
| AMADEUS HOLDING SA   | 429        | 73.00       | EUR | 73.00                |                       | 31 317               |
| ROYAL DUTCH SHELL B  | 492        | 26.72       | GBP | 29.96                |                       | 14 739               |
| ROTORK PLC           | 4 294      | 3.60        | GBP | 4.04                 |                       | 17 330               |
| TELEFONICA           | 3 826      | 7.69        | EUR | 7.69                 |                       | 29 426               |
| BCO SANTANDER C.HISP | 15 226     | 4.82        | EUR | 4.82                 |                       | 73 382               |
| IBERDROLA            | 2 906      | 6.65        | EUR | 6.65                 |                       | 19 325               |
| MASMOVIL IBERCOM     | 128        | 96.70       | EUR | 96.70                |                       | 12 378               |
| UNICREDITO ITALIANO  | 1 817      | 15.16       | EUR | 15.16                |                       | 27 553               |
| ENI SPA              | 547        | 16.46       | EUR | 16.46                |                       | 9 006                |

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2018-07-31

| Designação                               | Quantidade | Preço Unit. | Mda | Preço Unit.<br>(EUR) | Juro Corrido<br>(EUR) | Valor Total<br>(EUR) |
|--|------------|-------------|-----|----------------------|-----------------------|----------------------|
| BANCA INTESA                             | 8 591      | 2.63        | EUR | 2.63                 |                       | 22 629               |
| ENEL                                     | 3 536      | 4.77        | EUR | 4.77                 |                       | 16 867               |
| ESSITY AKTIEBO-B                         | 469        | 219.90      | SEK | 21.37                |                       | 10 025               |
| KONINKLIJKE AHOLD NV                     | 408        | 21.76       | EUR | 21.76                |                       | 8 876                |
| ING GROEP NV                             | 4 007      | 13.10       | EUR | 13.10                |                       | 52 500               |
| UNILEVER NV-CVA                          | 1 274      | 49.24       | EUR | 49.24                |                       | 62 732               |
| ASML NA                                  | 327        | 183.50      | EUR | 183.50               |                       | 60 005               |
| AKZO NOBEL NV NLG20                      | 173        | 79.10       | EUR | 79.10                |                       | 13 684               |
| ABN AMRO GROUP NV                        | 1 741      | 23.70       | EUR | 23.70                |                       | 41 262               |
| ASR NEDERLAND NV                         | 967        | 38.30       | EUR | 38.30                |                       | 37 036               |
| EURONEXT NV                              | 335        | 53.15       | EUR | 53.15                |                       | 17 805               |
| VESTAS WIND SYSTEMS                      | 174        | 411.10      | DKK | 55.18                |                       | 9 601                |
| ANHEUSER-BUSCH INB                       | 728        | 86.59       | EUR | 86.59                |                       | 63 038               |
| ERST BK DER OEST.SPA                     | 698        | 36.96       | EUR | 36.96                |                       | 25 798               |
| RAIFFEISEN INTL BK H                     | 1 276      | 28.53       | EUR | 28.53                |                       | 36 404               |
| TENARIS SA                               | 1 310      | 15.63       | EUR | 15.63                |                       | 20 475               |
| ARCELOR MITTAL                           | 658        | 27.52       | EUR | 27.52                |                       | 18 105               |
|  |            |             |     |                      |                       | 1 852 544            |
| Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU |            |             |     |                      | 36                    | 299 172              |
| Obrigações diversas                      |            |             |     |                      |                       |                      |
| F Float 12/21                            | 100 000    | 99.29%      | EUR | 99.29%               | 8                     | 99 299               |
| F Float 05/21                            | 100 000    | 99.75%      | EUR | 99.75%               | 22                    | 99 774               |
| AGN Float 06/19                          | 100 000    | 100.09%     | EUR | 100.09%              | 5                     | 100 098              |
|  |            |             |     |                      |                       | 299 172              |
|  |            |             |     |                      |                       | 12 330 472           |

## UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

|  |         |          |     |          |  |           |
|--|---------|----------|-----|----------|--|-----------|
| OIC domiciliados em Portugal             |         |          |     |          |  | 3 626 811 |
| CXG OBRIGAÇÕES                           | 390 013 | 4.45     | EUR | 4.45     |  | 1 737 311 |
| CXG IMOBILIARIO                          | 192 631 | 3.82     | EUR | 3.82     |  | 735 446   |
| CXG PRIVATE EQUITY                       | 16 936  | 5.64     | EUR | 5.64     |  | 95 480    |
| CXG INFRAESTRUTURAS                      | 34 705  | 6.76     | EUR | 6.76     |  | 234 724   |
| CXG LIQUIDEZ                             | 112 692 | 5.33     | EUR | 5.33     |  | 600 682   |
| F.I.MOB.IMOSOCIAL                        | 16 827  | 3.19     | EUR | 3.19     |  | 53 725    |
| FUNDIESTAMO I                            | 58      | 1 059.87 | EUR | 1 059.87 |  | 61 472    |
| Fnd I.Imob. MAXIRENT                     | 7 207   | 10.34    | EUR | 10.34    |  | 74 500    |
| LOGISTICA E DISTRIB.                     | 16 788  | 1.99     | EUR | 1.99     |  | 33 470    |
| OIC domiciliados num Estado-membro da EU |         |          |     |          |  | 8 275 371 |
| BROCK EURO MKT Fd D2                     | 35 038  | 33.06    | EUR | 33.06    |  | 1 158 356 |
| Amundi Funds II-Eur                      | 121 886 | 9.69     | EUR | 9.69     |  | 1 181 075 |
| Janus Hend H. Pan Al                     | 1 764   | 16.75    | EUR | 16.75    |  | 29 547    |
| Schroder ISF Euro Eq                     | 25 669  | 46.44    | EUR | 46.44    |  | 1 191 940 |
| MERRILL LYNCH MARSH                      | 469     | 144.64   | EUR | 144.64   |  | 67 836    |
| JAN HND UK Abs Ret                       | 9 278   | 7.25     | EUR | 7.25     |  | 67 297    |
| OLD MUTUAL GLOB EQ                       | 26 555  | 1.65     | EUR | 1.65     |  | 43 805    |
| MS PSAM GLOB UCITS                       | 38      | 1 343.78 | EUR | 1 343.78 |  | 51 064    |

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA  
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR  
Composição da Carteira em 2018-07-31

| Designação           | Quantidade | Preço Unit. | Mda | Preço Unit.<br>(EUR) | Juro Corrido<br>(EUR) | Valor Total<br>(EUR) |
|----------------------|------------|-------------|-----|----------------------|-----------------------|----------------------|
| SCH EUROP ALPHA ABS  | 431        | 103.98      | EUR | 103.98               |                       | 44 816               |
| LYXOR EPSILON GLOB E | 281        | 126.31      | EUR | 126.31               |                       | 35 493               |
| ALLIANZ RCM EUR EQTY | 625        | 1 869.55    | EUR | 1 869.55             |                       | 1 168 469            |
| Janus Hend Horiz Eur | 77 610     | 14.83       | EUR | 14.83                |                       | 1 150 956            |
| LFIS-VIS PR-M€A      | 112        | 1 023.65    | EUR | 1 023.65             |                       | 114 649              |
| DNCA INVEST-MIURA-I  | 181        | 124.03      | EUR | 124.03               |                       | 22 449               |
| HYPO DJ ESTX 50 FRA  | 24 779     | 35.81       | EUR | 35.81                |                       | 887 336              |
| ISHARES S&P 500 MONT | 16 766     | 63.24       | EUR | 63.24                |                       | 1 060 282            |
|                      |            |             |     |                      |                       | 11 902 182           |

LIQUIDEZ

|                         |  |  |     |  |  |         |
|-------------------------|--|--|-----|--|--|---------|
| À vista                 |  |  |     |  |  | 598 358 |
| Depósitos à ordem       |  |  |     |  |  |         |
| DO CGD - CHF 0.0000%    |  |  | CHF |  |  | 402     |
| DO CGD - DKK 0.0000%    |  |  | DKK |  |  | 159     |
| DO CGD - EUR 0.0000%    |  |  | EUR |  |  | 217 546 |
| DO CGD - GBP 0.0000%    |  |  | GBP |  |  | 742     |
| DO CGD - NOK 0.0000%    |  |  | NOK |  |  | 58      |
| DO CGD - SEK 0.0000%    |  |  | SEK |  |  | 36      |
| DO CGD - USD 0.0000%    |  |  | USD |  |  | 348 927 |
| DO RBS - USD AJ 0.0000% |  |  | USD |  |  | 30 486  |
|                         |  |  |     |  |  | 598 358 |
|                         |  |  |     |  |  | 598 358 |

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

|                  |  |  |  |  |  |            |
|------------------|--|--|--|--|--|------------|
| Valores Activos  |  |  |  |  |  | 28 487     |
| Valores Passivos |  |  |  |  |  | -24 409    |
|                  |  |  |  |  |  | 4 079      |
|                  |  |  |  |  |  | 24 835 091 |

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO  
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS  
OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

|                          |    |        |     |        |  |          |
|--------------------------|----|--------|-----|--------|--|----------|
| Em mercado regulamentado |    |        |     |        |  |          |
| Futuros                  |    |        |     |        |  |          |
| TYU8 USD CBT 09/18       | -5 | 119.45 | USD | 102.06 |  | -510 309 |

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO 3 950 683.32

Valor da Unidade de Participação: € 6.2863