

ANEXO 1

ISIN	CIC - ISP	Designação do Activo	Moeda Investimento	Quantidade / Valor investido	Valor Unitário	Tipo de Cotação VU/%VN	Valor Total	Juros Decorridos
DE0005933956	432	iSh EU STOXX50DE	EUR	54 125,00	33,095000	VU	1 791 266,88	
LU0274210672	932	DBX-Track MSCI USA	EUR	21 050,00	48,640000	VU	1 023 872,00	
Unid. Participação em FIM							2.815.138,88	
Instrumentos de Capital e unidades de participação							2.815.138,88	
DE0001135085	211	DBR 4.75% 04/07/28	EUR	300 000,00	145,815000	%VN	437 445,00	7 008,20
DE0001135390	211	DBR 3.25% 04/01/20	EUR	1 600 000,00	113,680000	%VN	1 818 880,00	51 430,14
ES0000012106	211	SPGB 4.3 31/10/19	EUR	1 000 000,00	114,575000	%VN	1 145 750,00	7 166,67
ES00000122E5	211	SPGB 4.65 30/7/25	EUR	1 300 000,00	125,845000	%VN	1 635 985,00	25 435,25
ES00000122X5	211	SPGB 3.25% 30/4/2016	EUR	2 090 000,00	101,060000	%VN	2 112 154,00	45 468,92
ES00000123X3	211	SPGB 4.4% 31/10/23	EUR	1 700 000,00	122,185000	%VN	2 077 145,00	12 500,82
ES0000012411	211	SPGB 5.75% 30/7/32	EUR	1 100 000,00	144,970000	%VN	1 594 670,00	26 613,39
ES00000124B7	211	SPGB 3,75% 31/10/18	EUR	1 000 000,00	110,025000	%VN	1 100 250,00	6 250,00
ES00000124C5	211	SPGB 5.15% 31/10/28	EUR	800 000,00	133,075000	%VN	1 064 600,00	6 885,48
ES0000012932	211	SPGB 4.2% 31/01/2037	EUR	700 000,00	123,035000	%VN	861 245,00	26 903,01
IT0001174611	211	BTPS 6.5% 01/11/27	EUR	1 500 000,00	149,325000	%VN	2 239 875,00	16 071,43
IT0001278511	211	BTPS 5.25% 01/11/29	EUR	515 000,00	139,050000	%VN	716 107,50	4 456,73
IT0001444378	211	BTPS 6% 01/05/31	EUR	1 000 000,00	150,915000	%VN	1 509 150,00	9 890,11
IT0003535157	211	BTPS 5% 01/08/34	EUR	770 000,00	140,520000	%VN	1 082 004,00	15 902,17
IT0003934657	211	BTPS 4% 01/02/2037	EUR	1 200 000,00	124,835000	%VN	1 498 020,00	19 826,09
IT0004489610	211	BTPS 4.25% 01/09/19	EUR	800 000,00	114,140000	%VN	913 120,00	11 302,20
IT0004644735	211	BTPS 4.5% 01/03/26	EUR	1 400 000,00	127,095000	%VN	1 779 330,00	20 942,31
IT0004801541	211	BTPS 5.5% 01/09/22	EUR	500 000,00	128,660000	%VN	643 300,00	9 141,48
Titulos de dívida Pública							24.229.030,50	323.194,40
E000A1HRVD5	213	ANNGR 3.625% 10/21	EUR	900 000,00	109,754000	%VN	987 786,00	7 487,70
ES0413211071	213	BBVASM 4.25/02/25	EUR	100 000,00	122,970000	%VN	122 970,00	3 386,30
ES0414970659	213	CABKSM 5% 22/02/16	EUR	1 050 000,00	100,629000	%VN	1 056 604,50	44 876,71
FR0010891317	213	EDF 4.625% 26/4/30	EUR	1 300 000,00	125,385000	%VN	1 630 005,00	40 904,71
FR0010948240	213	ALOPF 3.625% 5/10/18	EUR	1 500 000,00	107,631000	%VN	1 614 465,00	12 925,20
IT0004760655	213	ENIIM 4.875 11/10/17	EUR	1 735 000,00	107,951000	%VN	1 872 949,85	18 718,80
IT0005090813	213	UCGIM 0.75% 30/04/25		1 000 000,00	94,457000	%VN	944 570,00	6 102,74
XS0069971710	212	EIB 8% 11/10/2016		65 868,00	106,012000	%VN	69 827,98	1 156,35
XS0129547948	213	LBBW 6.195 21/05/31		250 000,00	147,649000	%VN	369 122,50	9 421,56
XS0162513211	213	RWE 5.75 14/02/33		515 000,00	122,139000	%VN	629 015,85	25 961,64
XS0162869076	213	TELEFO 5.875 02/33		500 000,00	133,643000	%VN	668 215,00	25 753,42
XS0193945655	213	ATLIM 5.875% 06/24	EUR	1 300 000,00	134,170000	%VN	1 744 210,00	42 778,35
XS0229567440	213	GE 4.125% 19/09/2035	EUR	10 000,00	118,651000	%VN	11 865,10	116,09
XS0542522692	213	ATLIM 3.375% 18/9/17	EUR	900 000,00	105,215000	%VN	946 935,00	8 631,15
XS0878008225	212	EIB 2.625% 15/03/35	EUR	1 000 000,00	117,653000	%VN	1 176 530,00	20 928,08
XS0923361827	213	AALLN 2.5% 29/04/21	EUR	800 000,00	69,412000	%VN	555 296,00	13 442,62
XS1023703090	213	ENIIM 3.625% 29/1/29	EUR	900 000,00	114,153000	%VN	1 027 377,00	30 032,88
XS1050917373	213	VW 2.125% 04/04/22	EUR	1 200 000,00	100,453000	%VN	1 205 436,00	18 932,88
XS1176079843	213	ENELIM 1.966 27/1/25	EUR	500 000,00	102,174000	%VN	510 870,00	9 102,85
XS1178105851	213	TRNIM 0.875% 2/2/22	EUR	1 000 000,00	98,151000	%VN	981 510,00	7 958,90
Outros titulos de dívida							18.125.560,78	348.618,93
Titulos de dívida, Instrumentos de Capital e unidades de participação							45.169.730,16	
Acréscimos e diferimentos								671.813,33