

31 de dezembro de 2013

ISIN	CIC - ISP	Designação do Ativo	Moeda Investimento	Quantidade / Valor investido	Valor Unitário	Tipo de Cotação VU/%VN	Valor Total	Juros Decorridos
LU0073680620	232	AXA WF-FRM EU R/V FC	EUR	13.912,00	54,720000	VU	761.264,64	
DE0005933956	432	ISHARES EU STOXX50DE	EUR	66.450,00	31,160000	VU	2.070.582,00	
<b>Unid. Participação em FIM</b>							<b>2.831.846,64</b>	
PTBCP0AM0007	121	BCP-NO	EUR	1.116.502,00	0,166400	VU	185.785,93	
PTBES0AM0007	121	BESCL	EUR	116.861,00	1,039000	VU	121.418,58	
ES0127797019	121	EDP Renováveis SA	EUR	52.467,00	3,861000	VU	202.575,09	
PTEDP0AM0009	121	EDP-Nom.	EUR	158.000,00	2,670000	VU	421.860,00	
PTGALOAM0009	121	Galp Energia	EUR	56.450,00	11,915000	VU	672.601,75	
PTJMT0AE0001	121	Jer.Martins-SGPS	EUR	45.000,00	14,215000	VU	639.675,00	
PTMEN0AE0005	121	Mota Engil SGPS	EUR	74.953,00	4,323000	VU	324.021,82	
PTPTC0AM0009	121	Portugal Telecom	EUR	105.785,00	3,160000	VU	334.280,60	
PTSON0AM0001	121	SONAE	EUR	433.434,00	1,049000	VU	454.672,27	
PTSNC0AM0006	121	SONAECOM	EUR	75.288,00	2,569000	VU	193.414,87	
PTZON0AM0006	121	ZON Optimus SGPS	EUR	64.445,00	5,400000	VU	348.003,00	
FR0000120404	221	ACCOR SA	EUR	2.000,00	34,300000	VU	68.600,00	
ES0113211835	221	BBVA	EUR	22.104,00	8,948000	VU	197.786,59	
ES0113900J37	221	BSCH - Espanha	EUR	12.789,00	6,506000	VU	83.205,23	
FR0000120172	221	CARREFOUR SA	EUR	3.000,00	28,810000	VU	86.430,00	
FR0000120644	221	DANONE	EUR	2.000,00	52,320000	VU	104.640,00	
DE0005140008	221	DEUTSCHE BANK AG	EUR	3.000,00	34,675000	VU	104.025,00	
FR0010908533	221	Edenred	EUR	2.000,00	24,330000	VU	48.660,00	
ES0118900010	221	FERROVIAL(EX CINTRA)	EUR	13.512,00	14,065000	VU	190.046,28	
ES0143416115	221	GAMESA CORP TECNOLOG	EUR	4.218,00	7,580000	VU	31.972,44	
ES0148396015	221	INDITEX	EUR	2.500,00	119,800000	VU	299.500,00	
FR0000125007	221	SAINT-GOBAIN (COMP)	EUR	3.500,00	39,975000	VU	139.912,50	
FR0000120578	221	SANOFI	EUR	1.000,00	77,120000	VU	77.120,00	
FR0000130809	221	SOCIETE GENERALE-A	EUR	1.250,00	42,220000	VU	52.775,00	
NL0000226223	221	STIMICROELECTRONICS	EUR	600,00	5,840000	VU	3.504,00	
IT0004781412	221	UNICREDITO IT (ITAL)	EUR	2.069,00	5,380000	VU	11.131,22	
<b>Ações</b>							<b>5.397.617,17</b>	
<b>Instrumentos de Capital e unidades de participação</b>							<b>8.229.463,81</b>	
IT0004019581	211	BTPS 3.75% 01/08/16	EUR	4.000.000,00	105,293000	%VN	4.211.720,00	61.956,52
IT0003535157	211	BTPS 5% 01/08/34	EUR	70.000,00	104,110000	%VN	72.877,00	1.445,65
IT0001278511	211	BTPS 5.25% 01/11/29	EUR	500.000,00	108,190000	%VN	540.950,00	4.350,83
DE0001135390	211	DBR 3.25% 04/01/20	EUR	7.500.000,00	111,845000	%VN	8.388.375,00	241.078,77
DE0001135085	211	DBR 4.75% 04/07/28	EUR	300.000,00	127,843000	%VN	383.529,00	7.027,40
NL0000102317	211	NETHER 5.5% 15/1/28	EUR	510.000,00	133,765000	%VN	682.201,50	26.897,26
ES00000122X5	211	SPGB 3 25% 30/4/2016	EUR	2.000.000,00	103,460000	%VN	2.069.200,00	43.630,14
ES00000121H0	211	SPGB 4.25% 31/01/14	EUR	1.000.000,00	100,173000	%VN	1.001.730,00	38.890,41
<b>Títulos de dívida Pública</b>							<b>17.350.582,50</b>	<b>425.276,98</b>
ES0413211113	213	BBVASM 3.25 24/1/16	EUR	100.000,00	104,133000	%VN	104.133,00	3.036,30
ES0413211782	213	BBVASM 3.50%05/12/17	EUR	1.900.000,00	106,980000	%VN	2.032.620,00	4.736,99
ES0413211071	213	BBVASM 4 25/02/25	EUR	100.000,00	106,450000	%VN	106.450,00	3.386,30
ES0414970659	213	CABKSM 5% 22/02/16	EUR	2.000.000,00	107,920000	%VN	2.158.400,00	85.479,45
FR0010526848	213	CAFP 5.125 10/10/14	EUR	700.000,00	103,515000	%VN	724.605,00	8.059,59
FR0010758888	213	EDF 4.5 17/07/14	EUR	1.500.000,00	102,137000	%VN	1.532.055,00	30.883,56
XS0069971710	212	EIB 8% 11/10/2016	EUR	65.868,00	119,289000	%VN	78.573,28	1.156,35
XS0363471805	213	GE 5.25 18/05/15	EUR	1.000.000,00	106,034000	%VN	1.060.340,00	32.650,68
XS0397540294	213	IBM 6.625% 30/01/14	EUR	1.200.000,00	100,414000	%VN	1.204.968,00	72.965,75
XS0236951207	213	IMTLN 4 11/12/15	EUR	50.000,00	105,703000	%VN	52.851,50	109,59
XS0467864160	213	ISPIM 3.75% 23/11/16	EUR	2.000.000,00	104,987000	%VN	2.099.740,00	7.808,22
XS0222766973	213	KPN 4 22/06/15	EUR	1.200.000,00	104,404000	%VN	1.252.848,00	25.249,32
XS0129547948	213	LBBW 6.195 21/05/31	EUR	250.000,00	130,036000	%VN	325.090,00	9.421,56
FR0010754663	213	MCFP 4.375% 12/05/14	EUR	1.400.000,00	101,368000	%VN	1.419.152,00	39.099,32
XS0235620142	213	MS 4% 17/11/15	EUR	500.000,00	105,391000	%VN	526.955,00	2.410,96
XS0162513211	213	RWE 5.75 14/02/33	EUR	500.000,00	124,487000	%VN	622.435,00	25.205,48
XS0241946630	213	TELEFO 4.375% 2/2/16	EUR	500.000,00	106,315000	%VN	531.575,00	19.897,26
XS0731679907	213	VW 2.125% 19/01/2015	EUR	1.300.000,00	101,529000	%VN	1.319.877,00	26.186,99
DE0008079575	213	WESTLB 5 15/12/15	EUR	920.000,00	107,188000	%VN	986.129,60	2.016,44
<b>Outros títulos de dívida</b>							<b>18.138.797,38</b>	<b>399.760,11</b>
<b>Títulos de dívida, Instrumentos de Capital e unidades de participação</b>							<b>43.718.843,69</b>	
<b>Acréscimos e diferimentos</b>								<b>825.037,09</b>