

FUNDO DE PENSÕES ABERTO RENDIMENTO ACTIVO

COMPOSIÇÃO DO FUNDO EM 31.08.2011

Designação	Quantidade/Valor Nominal	Cotação (eur)	Montante Juros (eur)	Montante Global (eur)
<b>1 Valores Mobiliários Cotados</b>				
<b>1.1 Mercado de Cotações Oficiais de Bolsa V Port</b>				
<b>1.1.1 Títulos de Dívida Pública</b>				
OT ABR TF 05/21	50.000,00	61,18%	720,56	31.310,56
Sub-total				31.310,56
<b>1.1.2 Outros Fundos Públicos e Equiparados</b>				
<b>1.1.3 Obrigações Diversas</b>				
Sub-total				-
<b>1.1.4 Acções</b>				
Sub-total				-
<b>Sub-total</b>				<b>31.310,56</b>
<b>1.2 Mercado de Cotações Oficiais de Bolsa V U.E</b>				
<b>1.2.1 Títulos de Dívida Pública</b>				
BOTS T-BILL 10/14/11	250.000,00	99,86%	-	249.650,00
DUTCH TREASURY CERT 10/31/11	250.000,00	99,91%	-	249.762,50
FRENCH TREASURY NOTE TF 09/12	110.000,00	99,94%	777,53	110.711,53
FRENCH TREASURY NOTE TF 08/13	110.000,00	106,48%	662,70	117.785,20
NETHERLANDS GOVT TF 09/12	200.000,00	100,66%	3.082,19	204.392,19
Sub-total				932.301,43
<b>1.2.2 Outros Fundos Públicos e Equiparados</b>				
EUROPEAN UNION TF 09/14	400.000,00	104,25%	5.256,83	422.236,83
KFW TF 07/18	50.000,00	112,06%	340,68	56.370,68
Sub-total				478.607,51
<b>1.2.3 Obrigações Diversas</b>				
BUNDESSCHATZANW TF 10/12	200.000,00	100,24%	912,57	201.392,57
DANSK BANK FRN 07/12	50.000,00	99,49%	137,73	49.883,23
Sub-total				251.275,79
<b>1.2.4 Acções</b>				
<b>1.3 Mercado de Cotações Oficiais de Bolsa V Não U.E</b>				
<b>1.3.1 Títulos de Dívida Pública</b>				
<b>1.3.2 Outros Fundos Públicos e Equiparados</b>				
<b>1.3.3 Obrigações Diversas</b>				
<b>1.3.4 Acções</b>				
<b>Sub-total</b>				<b>1.662.184,73</b>
<b>2 Valores Não Cotados</b>				
<b>2.1 Valores Mobiliários Nacionais</b>				
<b>2.1.3 Obrigações Diversas</b>				
<b>2.2 Valores Mobiliários Estrangeiros</b>				
<b>2.2.3 Obrigações Diversas</b>				
<b>3 UNID. PART. INST. INVEST COLECTIVO</b>				
<b>3.1 Fundos Harmonizados</b>				
VISION ESCRITÓRIOS	8.550,00	4,58		39.149,60
IBERIA FUNDO ESP INVEST IMOB	3.000,00	1,31		3.924,00
LYXOR ETF DJ EURO STOXX 50	4.750,00	22,40		106.400,00
ISHARES ETF DJ EURO STOXX 50	500,00	23,08		11.540,00
SHRODER ISF EURO EQUITY C	10.299,92	19,23		198.067,46
SCHRODER INT EURO CORP - XD	650,00	112,35		73.027,50
DB X-TRACKERS MSCI USA TRN	2.956,00	20,10		59.415,60
DB X-TRACKERS RUSSEL 2000	432,00	64,33		27.790,56
LYXOR ETF COMMODITIES CRB-AD	4.531,00	22,54		102.106,09
Sub-total				621.420,80
<b>3.2 Fundos Não Harmonizados</b>				<b>621.420,80</b>
<b>Sub-total</b>				
<b>5 Líquidez</b>				
<b>5.1 Depósitos à Ordem</b>				<b>48.694,39</b>
<b>5.2 Depósitos a Prazo</b>				-
<b>5.3 Pendentes de Liquidação</b>				<b>352,03</b>
<b>Valor Fundo</b>				<b>2.363.258,39</b>
<b>Unidades de Participação em circulação</b>				<b>482.141,80</b>
<b>Valor Unitário da Unidade de Participação</b>				<b>4,90158</b>