

COMPOSIÇÃO DO FUNDO EM 30.06.2011

Designação	Quantidade/Valor Nominal	Cotação (eur)	Montante Juros (eur)	Montante Global (eur)
1 Valores Mobiliários Cotados				
1.1 Mercado de Cotações Oficiais de Bolsa V Port				
1.1.1 Títulos de Dívida Pública				
OT ABR TF 05/21	50.000,00	58,02%	394,47	29.404,47
Sub-total				29.404,47
1.1.2 Outros Fundos Públicos e Equiparados				
1.1.3 Obrigações Diversas				
Sub-total				-
1.1.4 Acções				
Sub-total				-
Sub-total				29.404,47
1.2 Mercado de Cotações Oficiais de Bolsa V U.E				
1.2.1 Títulos de Dívida Pública				
BOTS T-BILL 10/14/11	250.000,00	99,52%	-	248.787,50
DUTCH TREASURY CERT 10/31/11	250.000,00	99,60%	-	249.000,00
FRENCH TREASURY NOTE TF 09/12	110.000,00	99,13%	637,40	109.674,90
FRENCH TREASURY NOTE TF 08/13	110.000,00	105,58%	4.773,70	120.911,70
NETHERLANDS GOVT TF 09/12	200.000,00	100,63%	2.232,88	203.482,88
Sub-total				931.856,97
1.2.2 Outros Fundos Públicos e Equiparados				
KFW TF 07/18	50.000,00	107,29%	2.157,53	55.803,53
Sub-total				55.803,53
1.2.3 Obrigações Diversas				
BUNDESSCHATZANW TF 10/12	200.000,00	99,77%	573,77	200.103,77
DANSK BANK FRN 07/12	50.000,00	99,68%	2,19	49.839,69
Sub-total				249.943,46
1.2.4 Acções				
1.3 Mercado de Cotações Oficiais de Bolsa V Não U.E				
1.3.1 Títulos de Dívida Pública				
1.3.2 Outros Fundos Públicos e Equiparados				
1.3.3 Obrigações Diversas				
1.3.4 Acções				
Sub-total				1.237.603,96
2 Valores Não Cotados				
2.1 Valores Mobiliários Nacionais				
2.1.3 Obrigações Diversas				
2.2 Valores Mobiliários Estrangeiros				
2.2.3 Obrigações Diversas				
3 UNID. PART. INST. INVEST COLECTIVO				
3.1 Fundos Harmonizados				
VISION ESCRITÓRIOS	8.550,00	4,56		39.013,65
IBERIA FUNDO ESP INVEST IMOB	3.000,00	3,30		9.911,70
LYXOR ETF DJ EURO STOXX 50	4.750,00	29,02		137.845,00
ISHARES ETF DJ EURO STOXX 50	500,00	28,67		14.335,00
SHRODER ISF EURO EQUITY C	10.299,92	23,52		242.254,12
SCHRODER INT EURO CORP - XD	650,00	115,17		74.860,50
DB X-TRACKERS MSCI USA TRN	2.956,00	21,70		64.145,20
DB X-TRACKERS RUSSEL 2000	432,00	72,85		31.471,20
DB X-TRACKERS II EONIA	700,00	139,09		97.364,40
LYXOR ETF COMMODITIES CRB-AD	4.531,00	22,54		102.128,74
Sub-total				813.329,51
3.2 Fundos Não Harmonizados				813.329,51
Sub-total				
5 Liquidez				
5.1 Depósitos à Ordem				467.164,11
5.2 Depósitos a Prazo				-
5.3 Pendentes de Liquidação				308,47
Valor Fundo				2.547.193,51
Unidades de Participação em circulação				504.638,36
Valor Unitário da Unidade de Participação				5,04756