

FUNDO DE PENSÕES ABERTO RENDIMENTO ACTIVO

COMPOSIÇÃO DO FUNDO EM 31.05.2011

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	63,61%	236,68	32.039,18
Sub-total				32.039,18
1.1.2 Outros Fundos Públicos e Equiparados				
1.1.3 Obrigações Diversas				
Sub-total				-
1.1.4 Acções				
Sub-total				-
Sub-total				32.039,18
1.2 Mercado de Cotações Oficiais de Bolsa V U.E				
1.2.1 Títulos de Dívida Pública				
BELGIUM KINGDOM 07/11	300.000,00	99,98%	587,65	300.515,65
DUTCH TREASURY CERT 05/31/11	257.500,00	100,00%	-	257.489,70
FRENCH TREASURY NOTE TF 09/12	110.000,00	99,10%	569,59	109.580,69
FRENCH TREASURY NOTE TF 08/13	110.000,00	105,69%	4.366,85	120.626,95
NETHERLANDS GOVT TF 09/12	200.000,00	100,79%	1.821,92	203.403,92
Sub-total				991.616,91
1.2.2 Outros Fundos Públicos e Equiparados				
KFW TF 07/18	50.000,00	107,84%	1.977,74	55.895,24
Sub-total				55.895,24
1.2.3 Obrigações Diversas				
BUNDESSCHATZANW TF 10/12	200.000,00	99,78%	409,84	199.969,84
DANSK BANK FRN 07/12	50.000,00	99,67%	109,64	49.945,64
Sub-total				249.915,47
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				1.297.427,62
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	4,55		38.891,39
IBERIA FUNDO ESP INVEST IMOB	3.000,00	3,31		9.934,20
LYXOR ETF DJ EURO STOXX 50	4.750,00	29,03		137.868,75
ISHARES ETF DJ EURO STOXX 50	500,00	28,97		14.485,00
SCHRODER ISF EURO EQUITY C	10.299,92	23,76		244.726,10
SCHRODER INT EURO CORP - XD	650,00	115,96		75.374,00
DB X-TRACKERS MSCI USA TRN	2.956,00	22,33		66.007,48
DB X-TRACKERS RUSSEL 2000	432,00	75,67		32.689,44
DB X-TRACKERS II EONIA	1.548,00	138,98		215.145,68
LYXOR ETF COMMODITIES CRB-AD	4.531,00	23,22		105.209,82
Sub-total				940.331,86
3.2 Fundos Não Harmonizados				940.331,86
Sub-total				
5 Liquidez				
5.1 Depósitos à Ordem				338.072,27
5.2 Depósitos a Prazo				-
5.3 Pendentes de Liquidação				310,95
Valor Fundo				2.607.559,91
Unidades de Participação em circulação				513.859,12
Valor Unitário da Unidade de Participação				5,07446