

CARTEIRA DETALHADA

Carteira em 2024.12.31

Designação	Moeda	Quant./ Mont. Nom.	Cotação	Juros Corridos	Valor Global	%
Valores Mobiliários Cotados						
Mercado de Cotações Oficiais de Bolsa de Valores Portuguesa						
Títulos de Dívida Pública						
OT-4.125%-14.04.2027	EUR	30,000,000	106.45%	884,897.27	32,251,997.27	13.71%
OTRV JULHO 2025	EUR	32,240,000	100.25%	668,006.51	33,075,654.51	14.06%
REGIAO AUTONOMA ACORES-1.006%-15.06.2029	EUR	20,000,000	100.00%	109,695.33	18,482,495.33	7.86%
					Sub-Total:	35.62%
Mercado de Cotações Oficiais de Bolsa de Valores de Estados Membros da União Europeia						
Títulos de Dívida Pública						
EUROPEAN UNION BILL CZ 07.03.2025	EUR	3,800,000	99.48%		3,781,798.00	1.61%
					Sub-Total:	1.61%
Obrigações Diversas						
ACCOR SA-1.75%-04.02.2026	EUR	15,300,000	100.59%	415,106.56	15,533,801.56	6.60%
AP MOLLER-MAERSK A/S-1.75%-16.03.2026	EUR	15,000,000	100.63%	208,561.64	15,038,911.64	6.39%
BONOS OBLI DEL ESTADO-2.55%-31.10.2032	EUR	15,000,000	98.28%	63,924.66	14,755,374.66	6.27%
BPIFRANCE FINANC SA-2%-02.09.2030	EUR	6,000,000	95.36%	39,452.05	5,744,252.05	2.44%
DOVER CORP-0.75%-04.11.2027	EUR	16,500,000	99.94%	19,325.34	15,607,700.34	6.63%
FORTUM OYJ-1.625%-27.02.2026	EUR	10,000,000	100.35%	136,748.63	10,018,748.63	4.26%
JPMORGAN CHASE & CO-TV-14.08.2029	EUR	15,000,000	100.21%	77,040.83	14,289,540.83	6.07%
LOREAL SA-2.875%-06.11.2031	EUR	1,000,000	99.96%	4,332.19	1,004,452.19	0.43%
NOVO NORDISK 3.25% 21.01.2031	EUR	7,000,000	102.40%	139,234.97	7,276,294.97	3.09%
RCI BANQUE SA-1.625%-26.05.2026	EUR	10,000,000	100.73%	97,500.00	9,894,500.00	4.21%
RCI BANQUE SA-1.75%-10.04.2026	EUR	5,000,000	100.58%	63,527.40	4,973,577.40	2.11%
ROBERT BOSCH GMBH-3.625%-02-06-2027	EUR	7,000,000	100.00%	147,383.56	7,267,293.56	3.09%
UNILEVER CAPITAL CORP-3.3%-06.06.29	EUR	8,600,000	99.99%	161,727.12	8,960,989.12	3.81%
					Sub-Total:	55.41%
Mercado de Cotações Oficiais de Bolsa de Valores de Estado não membro da UE						
Obrigações Diversas						
ASTRAZENECA FINANCE 3.121% 05.08.2030	EUR	3,000,000	101.18%	37,965.04	3,059,505.04	1.30%
JOHNSON & JOHNSON 3.2% 01.06.2032	EUR	7,500,000	102.87%	140,054.79	7,798,829.79	3.31%
					Sub-Total:	4.62%
Liquidez						
A vista						
Depósitos à Ordem						
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)					5,914,325.16	2.51%
					Sub-Total:	2.51%
Outros Valores a Regularizar						
Valores Activos						
Valores Activos						
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)					680,000.00	0.29%
Terceiros					-36,798.52	-0.02%
					Sub-Total:	0.27%
Valores Passivos						
Valores Passivos						
Terceiros					-17,751.55	-0.01%
					Sub-Total:	-0.01%
Operações Sobre Taxas de Juro						
Fora de mercado regulamentado						
Swaps						

CARTEIRA DETALHADA

Carteira em 2024.12.31

Designação	Moeda	Quant./ Mont. Nom.	Cotação	Juros Corridos	Valor Global	%
Swaps						
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)		-20,000,000	-19,071,756.2	-109,695.33	928,243.73	0.39%
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)		10,000,000	10,069,513.6	29,127.78	69,513.65	0.03%
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)		-30,000,000	-32,160,910.4	-884,897.27	-2,160,910.49	-0.92%
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)		16,500,000	16,513,165.5	70,746.50	13,165.55	0.01%
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)		-15,300,000	-15,452,617.3	-242,145.49	-152,617.38	-0.06%
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)		15,000,000	15,261,732.5	163,946.67	261,732.51	0.11%
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)		-16,500,000	-15,871,257.8	-19,325.34	628,742.16	0.27%
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)		30,000,000	30,408,637.5	214,044.99	408,637.54	0.17%
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)		15,300,000	15,700,828.2	269,321.22	400,828.23	0.17%
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)		-10,000,000	-10,062,794.8	-136,748.63	-62,794.82	-0.03%
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)		-15,000,000	-15,117,472.6	-208,561.64	-117,472.63	-0.05%
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)		-10,000,000	-10,013,846.7	-97,500.00	-13,846.73	-0.01%
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)		10,000,000	10,236,796.1	143,290.00	236,796.13	0.10%
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)		-5,000,000	-5,032,431.57	-63,527.40	-32,431.57	-0.01%
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)		20,000,000	20,043,548.5	23,697.78	43,548.59	0.02%
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)		5,000,000	5,049,909.24	36,319.17	49,909.24	0.02%
Depósito à Ordem - Conta remun. (no BPI)			S/COT	-811,906.99	501,043.71	0.21%
Derivados - SWAPS taxa de Juro		-7,000,000	-7,519,434.57	-139,234.97	-519,434.57	-0.22%
Derivados - SWAPS taxa de Juro		-7,000,000	-7,380,618.56	-147,383.56	-380,618.56	-0.16%
Derivados - SWAPS taxa de Juro		7,000,000	7,357,942.00	132,292.61	357,942.00	0.15%
Derivados - SWAPS taxa de Juro		7,000,000	7,074,422.51	17,046.36	74,422.51	0.03%
Derivados - SWAPS taxa de Juro		8,600,000	8,734,476.60	17,528.47	134,476.60	0.06%
Derivados - SWAPS taxa de Juro		-6,000,000	-5,952,793.95	-39,452.05	47,206.05	0.02%
Derivados - SWAPS taxa de Juro		-8,600,000	-9,140,887.32	-161,727.12	-540,887.32	-0.23%
Derivados - SWAPS taxa de Juro		-7,500,000	-8,090,835.05	-140,054.79	-590,835.05	-0.25%
Derivados - SWAPS taxa de Juro		-15,000,000	-15,312,706.0	-63,924.66	-312,706.01	-0.13%
Derivados - SWAPS taxa de Juro		6,000,000	6,225,338.28	76,320.00	225,338.28	0.10%
Derivados - SWAPS taxa de Juro		15,000,000	15,624,444.0	85,628.75	624,444.05	0.27%
Derivados - SWAPS taxa de Juro		7,500,000	7,786,546.00	20,081.25	286,546.00	0.12%
					Sub-Total:	0.17%

Total das aplicações:

235,262,429.63

Número de Unidades de Participação em Circulação: