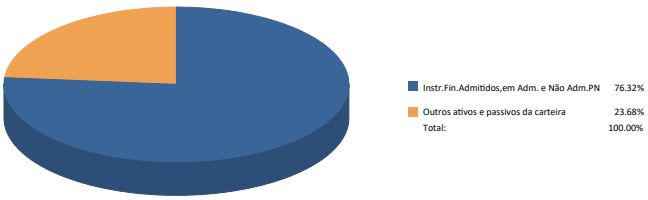
MONTEPIO GESTÃO DE ACTIVOS

Montepio
Gestão de Activos

Rua do Carmo, 42, 7º andar, Sala D, 1200-094, Lisboa
Nome: Montepio Tesouraria (Consolidado)
Composição da Carteira em: 2024-03-31

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR GRUPO

Grupo de Activos	Valor (EUR)	Peso (%)
Instr.Fin.Admitidos,em Adm. e Não Adm.PN	113 591 862.15	76.32
Outros ativos e passivos da carteira	35 251 112.84	23.68
TOTAL	**148 842 974.99**	**100.00**



COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
INSTR.FIN.ADMITIDOS,EM ADM. E NÃO ADM.PN						**113 591 862.15**	**76.32**
INSTRUMENTOS FINANC. ADM. NEGOCIAÇÃO PN						109 103 040.75	73.30
Títulos de dívida pública						20 544.14	0.01
PGB Float 23/07/25	PTOTVMOE0000	20 000.00	101.78%	188.14	EUR	20 544.14	0.01
Obrigações diversas						73 695 276.61	49.51
C 2.375% 22/5/2024	XS1068874970	900 000.00	99.80%	18 396.52	EUR	916 556.02	0.62
MS 1.75% 30/01/25	XS1180256528	700 000.00	98.43%	2 075.14	EUR	691 113.14	0.46
BNFP 1.25% 30/05/24	FR0013063609	800 000.00	99.59%	8 387.98	EUR	805 131.98	0.54
UNANA 0.5% 04/29/24	XS1403014936	800 000.00	99.75%	3 693.99	EUR	801 677.99	0.54
SIEGR 0.25% 05/06/24	XS2182055181	1 000 000.00	99.44%	2 056.01	EUR	996 501.01	0.67
WFC 0.50% 26/04/2024	XS1987097430	800 000.00	99.78%	3 726.78	EUR	801 934.78	0.54
MCFP 0.75% 26/05/24	FR0013257623	700 000.00	99.58%	4 461.07	EUR	701 493.07	0.47
CCEP 1.125% 26/05/24	XS1415535340	800 000.00	99.58%	7 647.54	EUR	804 255.54	0.54
MCD 2.375% 27/11/24	XS0857662448	500 000.00	99.10%	4 088.11	EUR	499 570.61	0.34
NESNVX 0% 12/11/2024	XS2170362326	500 000.00	97.88%		EUR	489 385.00	0.33
PG 0.625% 30/10/2024	XS1900750107	800 000.00	98.25%	2 103.83	EUR	788 131.83	0.53
BMO Float 06/06/25	XS2632933631	1 300 000.00	100.34%	4 114.21	EUR	1 308 527.71	0.88
BACR Float 12/05/26	XS2342059784	1 100 000.00	100.63%	7 333.39	EUR	1 114 219.39	0.75
BBVASM Flt 11/26/25	XS2485259670	2 600 000.00	101.42%	12 499.86	EUR	2 649 445.86	1.78
SANTAN Float 29/1/26	XS2293577354	2 000 000.00	100.23%	16 117.50	EUR	2 020 807.50	1.36
SANTAN Float 16/1/25	XS2575952341	4 400 000.00	100.43%	41 632.80	EUR	4 460 420.80	3.00
LLOYDS Flt 21/06/24	XS1633845158	900 000.00	100.16%	1 296.63	EUR	902 768.13	0.61
BNP Float 07/06/24	XS1626933102	1 050 000.00	100.13%	3 409.58	EUR	1 054 722.08	0.71
BNP Float 20/03/26	FR001400OTT0	200 000.00	100.09%	281.87	EUR	200 455.87	0.13
HSBC Float 24/09/26	XS2388490802	1 200 000.00	100.82%	1 149.40	EUR	1 210 935.40	0.81
MS Float 19/03/27	XS2790333616	700 000.00	100.26%		EUR	701 799.00	0.47
GS Float 03/19/26	XS2322254165	2 650 000.00	100.79%	4 715.82	EUR	2 675 637.57	1.80
BAC Float 22/09/26	XS2387929834	4 120 000.00	100.88%	5 632.96	EUR	4 162 053.76	2.80

Montepio
Gestão de Activos

Rua do Carmo, 42, 7º andar, Sala D, 1200-094, Lisboa
Nome: Montepio Tesouraria (Consolidado)
Composição da Carteira em: 2024-03-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

Instr.Fin.Admitidos,em Adm. e Não Adm.PN > Instrumentos Financ. Adm. Negociação PN > Obrigações diversas

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
TD Float 20/01/2025	XS2577740157	2 900 000.00	100.33%	24 923.89	EUR	2 934 377.89	1.97
ABIBB Float 15/04/24	BE6301509012	900 000.00	100.01%	8 165.85	EUR	908 237.85	0.61
SRGIM Float 02/08/24	XS1657785538	200 000.00	100.03%	1 411.08	EUR	201 467.08	0.14
NWG Float 13/01/2026	XS2576255751	1 500 000.00	101.15%	15 791.42	EUR	1 533 101.42	1.03
NWG Float 09/01/2026	XS2745115597	1 000 000.00	100.53%	10 458.00	EUR	1 015 733.00	0.68
SOCGEN Float 22/5/24	XS1616341829	800 000.00	100.10%	4 110.60	EUR	804 910.60	0.54
SOCGEN Flt 13/01/25	FR001400F315	1 900 000.00	100.29%	17 848.60	EUR	1 923 377.60	1.29
SOCGEN Float 19/1/26	FR001400N9V5	2 500 000.00	100.38%	22 320.76	EUR	2 531 933.26	1.70
TOYOTA Flt 08/31/25	XS2675093285	2 300 000.00	100.23%	8 774.76	EUR	2 314 156.76	1.55
BNS Float 02/05/2025	XS2618508340	3 000 000.00	100.36%	21 313.75	EUR	3 032 173.75	2.04
BNS Float 12/12/25	XS2733010628	300 000.00	100.46%	743.33	EUR	302 133.83	0.20
RY Float 17/01/2025	XS2577030708	2 300 000.00	100.29%	20 882.08	EUR	2 327 448.58	1.56
NACN Float 13/06/25	XS2635167880	1 600 000.00	100.34%	3 781.42	EUR	1 609 165.42	1.08
DAIGR Float 03/07/24	DE000A2GSCY9	1 400 000.00	100.11%	15 086.98	EUR	1 416 626.98	0.95
ABNANV Float 10/1/25	XS2573331837	1 500 000.00	100.24%	14 606.25	EUR	1 518 153.75	1.02
T Float 06/03/2025	XS2595361978	600 000.00	100.31%	1 877.20	EUR	603 755.20	0.41
RABOBK Float 11/3/26	XS2712747182	800 000.00	100.88%	5 567.64	EUR	812 643.64	0.55
VW Float 16/11/2024	XS1910947941	2 000 000.00	100.86%	13 680.00	EUR	2 030 950.00	1.36
ACAFP Float 07/03/25	FR001400GDG7	3 100 000.00	100.27%	9 140.69	EUR	3 117 479.69	2.09
BFCM Float 28/04/25	FR001400HO25	1 800 000.00	100.19%	13 371.75	EUR	1 816 755.75	1.22
BFCM Float 12/01/26	FR001400N3K1	500 000.00	100.28%	4 873.33	EUR	506 283.33	0.34
ISPIM Float 17/03/25	XS2597970800	3 000 000.00	100.34%	5 317.67	EUR	3 015 637.67	2.03
ISPIM Float 16/11/25	XS2719281227	900 000.00	100.68%	5 312.25	EUR	911 450.25	0.61
INTNED Flt 02/10/26	XS2697966690	800 000.00	100.81%	9 106.00	EUR	815 598.00	0.55
BMW Float 11/07/2025	XS2649033359	1 300 000.00	100.14%	12 074.40	EUR	1 313 900.90	0.88
SGOFP Float 18/07/24	XS2576245364	200 000.00	100.02%	1 683.09	EUR	201 714.09	0.14
CM Float 09/06/2025	XS2634071489	1 900 000.00	100.30%	4 908.81	EUR	1 910 646.81	1.28
MBGGR Float 29/09/25	DE000A3LNY11	600 000.00	100.11%	273.47	EUR	600 906.47	0.40
OPBANK Flt 11/21/25	XS2722262966	900 000.00	100.29%	4 412.00	EUR	907 013.00	0.61
Outros instrum. de dívida de curto prazo						35 387 220.00	23.77
BUBILL 0% 15/05/2024	DE000BU0E055	5 000 000.00	99.57%		EUR	4 978 475.00	3.34
BTF 0% 10/04/2024	FR0128227701	5 000 000.00	99.93%		EUR	4 996 350.00	3.36
SGLT 0% 09/08/2024	ES0L02408091	500 000.00	98.70%		EUR	493 497.50	0.33
SGLT 0% 10/05/2024	ES0L02405105	1 500 000.00	99.62%		EUR	1 494 330.00	1.00
BTF 0% 23/05/2024	FR0128227735	8 000 000.00	99.47%		EUR	7 957 880.00	5.35
BTF 0% 21/08/2024	FR0128227776	7 300 000.00	98.57%		EUR	7 195 354.50	4.83
BGTB 0% 11/07/2024	BE0312795678	700 000.00	98.97%		EUR	692 769.00	0.47
BUBILL 0% 18/09/24	DE000BU0E097	7 000 000.00	98.35%		EUR	6 884 255.00	4.63
BTF 0% 19/06/2024	FR0128227750	700 000.00	99.19%		EUR	694 309.00	0.47
INSTRUMENTOS FINANCEIROS NÃO ADM. NEG.PN						4 488 821.40	3.02
Papel comercial						4 488 821.40	3.02

Montepio
Gestão de Activos

Rua do Carmo, 42, 7º andar, Sala D, 1200-094, Lisboa
Nome: Montepio Tesouraria (Consolidado)
Composição da Carteira em: 2024-03-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

Instr.Fin.Admitidos,em Adm. e Não Adm.PN > Instrumentos Financeiros Não Adm. Neg.PN > Papel comercial

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
CF/4.20%/2024-04-04 NOS SGPS SA	PTZM8SJM0157			2 916.67	EUR	1 002 916.67	0.67
CF/4.12%/2024-05-28 Ren-Rede Energ Nac	PTRE17JM0070			1 136.51	EUR	2 483 804.73	1.67
CF/4.20%/2024-04-11 NOS SGPS SA	PTZM8XJM0150			2 100.00	EUR	1 002 100.00	0.67
OUTROS ATIVOS E PASSIVOS DA CARTEIRA						**35 251 112.84**	**23.68**
LIQUIDEZ						38 238 123.06	25.69
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						-2 987 010.22	-2.01
TOTAL						**148 842 974.99**	**100.00**

Saldos de Unidades de Participação

	Valor (EUR)
CATEGORIA A	
Valor (EUR)	98 059 601.230000
Quantidade	1 016 784.776000
Cotação	96.440900
CATEGORIA I	
Valor (EUR)	50 783 373.760000
Quantidade	526 092.557900
Cotação	96.529400
TOTAL	**148 842 974.990000**

Câmbios

EUR / EUR	1.000000