



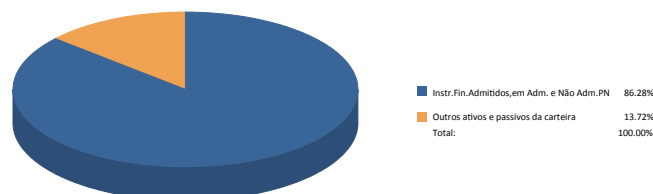
Rua do Carmo, 42, 7º andar, Sala D, 1200-094, Lisboa

Nome: Montepio Obrigações (Consolidado)

Composição da Carteira em: 2022-12-31

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA POR GRUPO

Grupo de Activos	Valor (EUR)	Peso (%)
Instr.Fin.Admitidos,em Adm. e Não Adm.PN	9 021 080	86.28
Outros ativos e passivos da carteira	1 434 179	13.72
TOTAL	10 455 259	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						9 021 080	86.28
INSTRUMENTOS FINANC. ADM. NEGOCIAÇÃO PN						9 021 080	86.28
Títulos de dívida pública						421 558	4.03
PGB Float 23/07/25	PTOTVMOE0000	20 000.00	102.17%	147	EUR	20 581	0.20
BOTS 0% 12/05/2023	IT0005494502	35 000.00	99.21%		EUR	34 722	0.33
SGLT 0% 12/05/2023	ES0L02305123	84 000.00	99.25%		EUR	83 367	0.80
PORTB 0% 19/05/2023	PTPBTOGE0050	84 000.00	99.40%		EUR	83 494	0.80
BGTB 0% 09/03/2023	BE0312787592	100 000.00	99.68%		EUR	99 678	0.95
PORTB 0% 17/03/2023	PTPBTIGE0041	100 000.00	99.72%		EUR	99 717	0.95
Obrigações diversas						7 833 400	74.92
ANZ 0.625% 21/2/2023	XS1774629346	100 000.00	99.82%	538	EUR	100 354	0.96
SIEGR 0.375% 6/09/23	XS1874127811	100 000.00	98.73%	120	EUR	98 853	0.95
MS 1.875% 30/03/2023	XS1115208107	100 000.00	99.93%	1 423	EUR	101 353	0.97
JPM 2.75 01/02/23	XS0883614231	100 000.00	100.06%	2 516	EUR	102 575	0.98
TOYOTA 0.625%26/9/23	XS1884740041	200 000.00	98.60%	332	EUR	197 538	1.89
BMW 0.625% 6/10/2023	XS1948612905	100 000.00	98.37%	149	EUR	98 523	0.94
CAFP Float 12/09/23	FR0013446580	200 000.00	100.14%	293	EUR	200 569	1.92
BACR Float 12/05/26	XS2342059784	200 000.00	98.01%	746	EUR	196 763	1.88
BBVASM Flt 11/26/25	XS2485259670	400 000.00	100.88%	1 099	EUR	404 627	3.87
SANTAN Float 29/1/26	XS2293577354	500 000.00	99.09%	1 968	EUR	497 415	4.76
LLOYDS Flt 21/06/24	XS1633845158	200 000.00	100.60%	174	EUR	201 372	1.93
BNP Float 07/06/24	XS1626933102	342 000.00	100.82%	647	EUR	345 455	3.30
HSBC Float 24/09/26	XS2388490802	400 000.00	99.23%	140	EUR	397 050	3.80
CBAAU Float 08/03/23	XS1789454326	100 000.00	100.07%	166	EUR	100 233	0.96
GS Float 03/19/26	XS2322254165	460 000.00	99.22%	509	EUR	456 937	4.37
BAC Float 22/09/26	XS2387929834	500 000.00	98.64%	428	EUR	493 613	4.72
Citig.Float 21/03/23	XS1795253134	250 000.00	100.04%	196	EUR	250 296	2.39
CS Float 16/01/2026	CH0591979635	100 000.00	86.81%	502	EUR	87 310	0.84



Rua do Carmo, 42, 7º andar, Sala D, 1200-094, Lisboa

Nome: Montepio Obrigações (Consolidado)

Composição da Carteira em: 2022-12-31

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 (%)
ABIBB Float 15/04/24	BE6301509012	327 000.00	100.09%	1 158	EUR	328 459	3.14
SOCGEN Float 22/5/24	XS1616341829	400 000.00	100.75%	1 165	EUR	404 179	3.87
IBESM Float 20/02/24	XS1564443759	100 000.00	100.19%	282	EUR	100 469	0.96
BNS Float 02/01/24	XS2438833423	100 000.00	100.57%	405	EUR	100 973	0.97
RY Float 31/01/24	XS2437825388	100 000.00	100.61%	406	EUR	101 012	0.97
DAIGR Float 03/07/24	DE000A2GSCY9	400 000.00	100.24%	1 610	EUR	402 554	3.85
KBCBB Float 06/23/24	BE0002805860	200 000.00	99.98%	138	EUR	200 103	1.91
UCGIM Float 30/06/23	IT0005199267	150 000.00	100.05%	12	EUR	150 084	1.44
VW Float 16/11/2024	XS1910947941	300 000.00	101.46%	1 281	EUR	305 655	2.92
ACAFP Float 06/03/23	XS1787278008	300 000.00	100.07%	558	EUR	300 781	2.88
BPCEGP Flt 23/3/2023	FR0013323672	200 000.00	100.07%	130	EUR	200 276	1.92
INTNED Float 20/9/23	XS1882544205	200 000.00	100.48%	193	EUR	201 151	1.92
MIZUHO Flt 10/04/23	XS1801906279	100 000.00	100.08%	407	EUR	100 488	0.96
ORFP Float 29/3/2024	FR0014009EH2	200 000.00	100.86%	47	EUR	201 770	1.93
CM Float 26/01/2024	XS2436885748	200 000.00	100.59%	859	EUR	202 041	1.93
OPBANK Float 18/1/24	XS2287753987	200 000.00	100.78%	1 001	EUR	202 569	1.94
Ups / ações de OIC que não OII (ETFs)						766 121	7.33
ISH EUR CORP BND IRH	IE00B6X2VY59	4 794.00	92.78		EUR	444 763	4.25
IshaETF € Ultrashort	IE00BCRY6557	3 226.00	99.62		EUR	321 358	3.07
OUTROS ATIVOS E PASSIVOS DA CARTEIRA						1 434 179	13.72
LIQUIDEZ						1 482 212	14.18
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						-48 033	-0.46
TOTAL						10 455 259	100.00

Saldos de Unidades de Participação

	Valor (EUR)
Valor (EUR)	10 455 258.600000
Quantidade	113 674.849800
Cotação	91.975100

Câmbios

EUR / EUR	1.000000
-----------	----------