



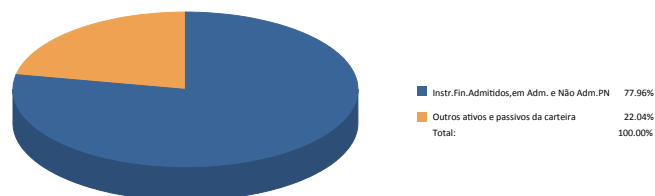
Rua do Carmo, 42, 7º andar, Sala D, 1200-094, Lisboa

Nome: Montepio Tesouraria (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	33 674 522	77.96
Outros ativos e passivos da carteira	9 518 287	22.04
TOTAL	43 192 809	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						33 674 522	77.96
INSTRUMENTOS FINANC. ADM. NEGOCIAÇÃO PN						33 174 411	76.81
Títulos de dívida pública						1 743 643	4.04
PGB Float 23/07/25	PTOTVMOE0000	20 000.00	102.17%	147	EUR	20 581	0.05
BOTS 0% 12/05/2023	IT0005494502	170 000.00	99.21%		EUR	168 652	0.39
SGLT 0% 12/05/2023	ES0L02305123	381 000.00	99.25%		EUR	378 129	0.88
PORTB 0% 19/05/2023	PTPBTOGE0050	381 000.00	99.40%		EUR	378 704	0.88
BGTB 0% 09/03/2023	BE0312787592	400 000.00	99.68%		EUR	398 710	0.92
PORTB 0% 17/03/2023	PTPB TIGE0041	400 000.00	99.72%		EUR	398 866	0.92
Obrigações diversas						31 430 769	72.77
ANZ 0.625% 21/2/2023	XS1774629346	400 000.00	99.82%	2 151	EUR	401 417	0.93
VW 0.875% 16/01/23	XS1167644407	600 000.00	99.95%	5 034	EUR	604 761	1.40
SIEGR 0.375% 6/09/23	XS1874127811	200 000.00	98.73%	240	EUR	197 705	0.46
MS 1.875% 30/03/2023	XS1115208107	400 000.00	99.93%	5 692	EUR	405 412	0.94
TOYOTA 2.375 01/2/23	XS0881362502	800 000.00	100.05%	17 386	EUR	817 766	1.89
UNANA 0.375 14/02/23	XS1566100977	400 000.00	99.79%	1 319	EUR	400 489	0.93
JPM 2.75 01/02/23	XS0883614231	400 000.00	100.06%	10 066	EUR	410 302	0.95
TOYOTA 0.625%26/9/23	XS1884740041	200 000.00	98.60%	332	EUR	197 538	0.46
BMW 0.625% 6/10/2023	XS1948612905	300 000.00	98.37%	447	EUR	295 570	0.68
SIEGR 0% 20/02/2023	XS2118276539	200 000.00	99.73%		EUR	199 462	0.46
CAFP Float 12/09/23	FR0013446580	1 000 000.00	100.14%	1 467	EUR	1 002 847	2.32
BACR Float 12/05/26	XS2342059784	600 000.00	98.01%	2 238	EUR	590 289	1.37
BBVASM Flt 11/26/25	XS2485259670	1 800 000.00	100.88%	4 944	EUR	1 820 820	4.22
SANTAN Flt 28/03/23	XS1689234570	900 000.00	100.15%	289	EUR	901 666	2.09
SANTAN Float 29/1/26	XS2293577354	1 300 000.00	99.09%	5 116	EUR	1 293 279	2.99
LLOYDS Flt 21/06/24	XS1633845158	900 000.00	100.60%	782	EUR	906 173	2.10
BNP Float 07/06/24	XS1626933102	1 250 000.00	100.82%	2 365	EUR	1 262 628	2.92
BNP Float 22/05/23	XS1823532996	450 000.00	100.18%	1 221	EUR	452 028	1.05



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

Nome: Montepio Tesouraria (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 (%)
HSBC Float 24/09/26	XS2388490802	1 200 000.00	99.23%	419	EUR	1 191 149	2.76
CBAAU Float 08/03/23	XS1789454326	250 000.00	100.07%	416	EUR	250 583	0.58
GS Float 03/19/26	XS2322254165	1 100 000.00	99.22%	1 216	EUR	1 092 675	2.53
BAC Float 22/09/26	XS2387929834	2 020 000.00	98.64%	1 729	EUR	1 994 196	4.62
Citig.Float 21/03/23	XS1795253134	1 100 000.00	100.04%	861	EUR	1 101 301	2.55
CS Float 16/01/2026	CH0591979635	400 000.00	86.81%	2 008	EUR	349 240	0.81
ABIBB Float 15/04/24	BE6301509012	900 000.00	100.09%	3 188	EUR	904 016	2.09
SRGIM Float 02/08/24	XS1657785538	200 000.00	99.26%	701	EUR	199 213	0.46
SOCGEN Float 22/5/24	XS1616341829	1 700 000.00	100.75%	4 951	EUR	1 717 760	3.98
IBESM Float 20/02/24	XS1564443759	500 000.00	100.19%	1 408	EUR	502 345	1.16
BNS Float 02/01/24	XS2438833423	400 000.00	100.57%	1 621	EUR	403 891	0.94
RY Float 31/01/24	XS2437825388	400 000.00	100.61%	1 622	EUR	404 048	0.94
DAIGR Float 03/07/24	DE000A2GSCY9	1 400 000.00	100.24%	5 635	EUR	1 408 939	3.26
KBCBB Float 06/23/24	BE0002805860	300 000.00	99.98%	206	EUR	300 154	0.69
T Float 05/09/23	XS1907118464	300 000.00	100.44%	635	EUR	301 962	0.70
UCGIM Float 30/06/23	IT0005199267	450 000.00	100.05%	36	EUR	450 252	1.04
VW Float 16/11/2024	XS1910947941	1 100 000.00	101.46%	4 696	EUR	1 120 734	2.59
ACAFP Float 06/03/23	XS1787278008	1 200 000.00	100.07%	2 232	EUR	1 203 126	2.79
BPCEGP Flt 23/3/2023	FR0013323672	1 300 000.00	100.07%	846	EUR	1 301 795	3.01
INTNED Float 20/9/23	XS1882544205	1 200 000.00	100.48%	1 159	EUR	1 206 907	2.79
MIZUHO Flt 10/04/23	XS1801906279	550 000.00	100.08%	2 240	EUR	552 683	1.28
ORFP Float 29/3/2024	FR0014009EH2	500 000.00	100.86%	118	EUR	504 425	1.17
CM Float 26/01/2024	XS2436885748	400 000.00	100.59%	1 718	EUR	404 082	0.94
OPBANK Float 18/1/24	XS2287753987	400 000.00	100.78%	2 003	EUR	405 139	0.94
INSTRUMENTOS FINANCEIROS NÃO ADM. NEG.PN						500 111	1.16
Papel comercial						500 111	1.16
CF/0.80%/2023-01-05 NOS SGPS SA						500 111	1.16
OUTROS ATIVOS E PASSIVOS DA CARTEIRA						9 518 287	22.04
LIQUIDEZ						9 554 658	22.12
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						-36 371	-0.08
TOTAL						43 192 809	100.00

Saldos de Unidades de Participação

	Valor (EUR)
Valor (EUR)	43 192 809.190000
Quantidade	463 016.582200
Cotação	93.287600

S.G.C.

VALORIZAÇÃO CARTEIRAS INSTITUCIONAIS



Rua do Carmo, 42, 7º andar, Sala D, 1200-094, Lisboa
Nome: Montepio Tesouraria (Consolidado)
Composição da Carteira em: 2022-12-31

Câmbios

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