

GROUPAMA SEGUROS DE VIDA, SA

INVENTÁRIO DE TÍTULOS E PARTICIPAÇÕES FINANCEIRAS

INVENTÁRIO DE TÍTULOS E PARTICIPAÇÕES FINANCEIRAS

Ano: 2010
 Empresa de Seguros: GROUPAMA SEGUROS DE VIDA, S.A.
 Nº de identificação: 502 661 313
 Ident. do resp. pela informação: Paula Duarte

Valores em euros

IDENTIFICAÇÃO DOS TÍTULOS CÓDIGO	DESIGNAÇÃO	Quantidade	Montante do valor nominal	% do valor nominal	Preço médio de aquisição	Valor total de aquisição	Anexo 1	
							Valor de balanço unitário	Total
PTGAN0AM0005	1 - TÍTULOS DE EMPRESAS DO GRUPO E ASSOCIADAS							
	1.1 - Nacionais							
	1.1.1 - Partes de capital em filiais	...						
	1.1.2 - Partes de capital em associadas	...						
	1.1.3 - Partes de capital em empreendimentos conjuntos	...						
	1.1.4 - Partes de capital em outras empresas participadas ou participantes Groupama Portugal Seguros	1.500.000			16,40	24.600.000,00	16,40	24.600.000,00
	sub-total	1.500.000	0,00			24.600.000,00		24.600.000,00
	1.1.5 - Títulos de dívida de filiais	...						
	1.1.6 - Títulos de dívida de associadas	...						
	1.1.7 - Títulos de dívida de depreendimentos conjuntos	...						
	1.1.8 - Títulos de dívida de outras depresas participadas ou participantes	...						
	sub-total	0,00	0,00			0,00		0,00
	1.1.9 - Outros títulos em filiais	...						
	1.1.10 - Outros títulos em associadas	...						
	1.1.11 - Outros títulos em empreendimentos conjuntos	...						
	1.1.12 - Outros títulos em outras empresas participadas ou participantes	...						
	sub-total	0,00	0,00			0,00		0,00
	sub-total 1.1	1.500.000,00	0,00			24.600.000,00		24.600.000,00
	1.2 - Estrangeiras							
	1.2.1 - Partes de capital em filiais	...						
	1.2.2 - Partes de capital em associadas	...						
	1.2.3 - Partes de capital em empreendimentos conjuntos	...						
	1.2.4 - Partes de capital em outras empresas participadas ou participantes	...						
	sub-total	0,00	0,00			0,00		0,00
	1.2.5 - Títulos de dívida de filiais	...						
	1.2.6 - Títulos de dívida de associadas	...						
	1.2.7 - Títulos de dívida de depreendimentos conjuntos	...						
1.2.8 - Títulos de dívida de outras depresas participadas ou participantes	...							
sub-total	0,00	0,00			0,00		0,00	

GROUPAMA SEGUROS DE VIDA, SA
INVENTÁRIO DE TÍTULOS E PARTICIPAÇÕES FINANCEIRAS

IDENTIFICAÇÃO DOS TÍTULOS CÓDIGO	DESIGNAÇÃO	Quantidade	Montante do valor nominal	% do valor nominal	Preço médio de aquisição	Valor total de aquisição	Valor de balanço unitário	Total
	1.2.9 - Outros títulos em filiais							
	1.2.10 - Outros títulos em associadas							
	1.2.11 - Outros títulos em empreendimentos conjuntos							
	1.2.12 - Outros títulos em outras empresas participadas ou participantes							
	sub-total	0,00	0,00			0,00		0,00
	sub-total 1.2	0,00	0,00			0,00		0,00
	total 1	1.500.000	0,00			24.600.000,00		24.600.000,00
	2 - OUTROS TÍTULOS							
	2.1 - Nacionais							
	2.1.1 - Instrumentos de capital e unidades de participação							
	2.1.1.1 - Ações							
PTEDP0AM0009	E.D.P.-N	252.478			3,03	765.244,97	2,49	628.922,70
PTGAL0AM0009	GALP ENERGIA	83.353			11,76	980.384,74	14,34	1.195.282,02
921910017501	S.FRANCO PORT.COMUNIC.	2.785			0,02	49,88	0,02	49,88
	sub-total	338.616	0,00			1.745.679,59		1.824.254,60
	2.1.1.2 - Títulos de participação							
	sub-total	0,00	0,00			0,00		0,00
	2.1.1.3 - Unidades de participação em fundos de investimento							
PTYBRLM0000	BBVA GESTÃO FLEX T.T. FIA	330.106			5,45	1.800.000,00	5,36	1.769.069,10
PTSELAIE0007	IMOSOCIAL	350.000			6,10	2.133.525,30	6,53	2.285.885,01
PTYIMBHM0004	NOVIMOVEST	379.360			6,33	2.401.574,19	7,15	2.712.386,06
PTNOFAIM0008	VISION ESCRIT. (Imob.)	93.000			3,48	323.355,92	4,52	420.518,10
	sub-total	1.152.466	0,00			6.658.455,41		7.187.858,27
	2.1.1.4 - Outros							
	sub-total	0	0,00			0,00		0,00
	sub-total 2.1.1	1.491.082	0,00			8.404.135,00		9.012.112,87
	2.1.2 - Títulos de dívida							
	2.1.2.1 - De dívida pública							
PTOTEL0E0010	OT'S 4.35% 10/16/17		370.000,00	101,68		376.234,00	90,68	335.526,19
PTOTE40E0040	OT'S ABRIL 2011		360.000,00	97,39		350.608,52	102,20	367.927,03
PTOTEY0E0007	OT'S ABRIL 3.85% 15/04/2021		5.900.000,00	94,20		5.557.800,00	81,16	4.788.585,48
PTOTEN0E0018	OT'S JUNHO 4.45% 2018		1.500.000,00	99,19		1.487.814,20	91,44	1.371.662,46
PTOTEM0E0027	OT'S JUNHO 4.75% 2019		4.970.000,00	104,61		5.199.309,80	91,16	4.530.844,77
PTOTECO0E0029	OT'S JUNHO 4.8% 2020		487.800,00	99,84		487.024,40	90,07	439.346,76
PTOTES0E0007	OT'S MARÇO 4.1% 2037		1.300.000,00	88,65		1.152.428,00	73,39	954.129,12
PTOTE60E0006	OT'S OUT 4.20% 2016		1.580.000,00	103,42		1.634.013,60	92,18	1.456.365,43
PTOTE30E0017	OT'S OUT 3.35% 2015		100.000,00	101,23		101.232,00	91,01	91.010,71
PTOTEAOE0021	OT'S OUTUBRO 4.95% 2023		2.850.000,00	105,36		3.002.832,00	84,99	2.422.088,96
PTOTEG0E0009	OT'S SET.5.45% 2013		450.000,00	110,15		495.696,00	103,28	464.760,99
PTOTE10E0019	OT'S JUNHO 2003/ 2014		200.000,00	103,28		206.555,00	100,10	200.190,58
	sub-total	0	20.067.800,00			20.051.547,52		17.422.438,48
	2.1.2.2 - De outros emissores públicos							
PTCFPA0M0002	CP COMB.DE PORT.4.17% 2019		4.050.000,00	96,76		3.918.660,00	77,16	3.124.910,09
PTMTLDM00005	METROPOL.LX 5.75% 2019		4.000.000,00	102,29		4.091.786,00	99,74	3.989.453,21
PTCG1L0M0007	CGD 5.125% 2014		1.100.000,00	99,71		1.096.777,00	97,48	1.072.264,22
PTRELA0M0000	REN 6.375% 2013		2.250.000,00	100,99		2.272.236,50	107,21	2.412.310,06
	sub-total	0	11.400.000,00			11.379.459,50		10.598.937,58
	2.1.2.4 - Outros emissores							
PTBAFPOE0003	BANIF 3.25% 2012		1.060.000,00	100,61		1.066.466,00	98,61	1.045.268,90
PTBEMPOE0018	BESPL 3.75% 2012		1.750.000,00	101,26		1.771.975,00	101,68	1.779.448,90
	sub-total	0	2.810.000,00			2.838.441,00		2.824.717,80
	sub-total 2.1.2	0	34.277.800,00			34.269.448,02		30.846.093,86
	total 2.1	1.491.082	34.277.800,00			42.673.583,02		39.858.206,73

GROUPAMA SEGUROS DE VIDA, SA
INVENTÁRIO DE TÍTULOS E PARTICIPAÇÕES FINANCEIRAS

IDENTIFICAÇÃO DOS TÍTULOS CÓDIGO	DESIGNAÇÃO	Quantidade	Montante do valor nominal	% do valor nominal	Preço médio de aquisição	Valor total de aquisição	Valor de balanço unitário	Total
2.2 - Estrangeiros								
2.2.1 - Instrumentos de capital e unidades de participação								
2.2.1.1 - Ações								
IT0003506190	ATLANTIA SPA	8.085			13,24	107.079,36	15,27	123.457,95
IT0003106777	BENETTON GROUP	62.803			6,80	427.054,56	4,92	309.147,77
DE0008032004	COMMERZBANK AG	72.700			16,65	1.210.390,51	5,55	403.775,80
DE0005557508	DEUTSCHE TELEKOM	23.220			9,73	225.875,17	9,66	224.189,10
FR0000133308	FRANCE TELECOM	7.046			20,98	147.826,96	15,60	109.882,38
FR0000130809	SOC.GENERALE	4.375			28,79	125.970,36	40,22	175.962,50
FR0000127771	VIVENDI UNIVERSAL	8.000			23,79	190.285,00	20,20	161.600,00
	sub-total	186.229	0,00			2.434.481,92		1.508.015,50
2.2.1.2 - Títulos de participação								
	...							
	sub-total	0	0,00			0,00		0,00
2.2.1.3 - Unidades de participação em fundos de investimento								
FR0000029837	GR. CROISSANCE (SIC.AC) 4 DEC	3.250			485,38	1.577.485,00	391,82	1.273.415,00
FR0010013912	GROUPAMA DYNAMISME	8.119			96,03	779.683,52	89,66	727.989,17
FR0010013961	GROUPAMA EQUILIBRE	6.808			127,92	870.867,89	127,82	870.196,45
FR0010013953	GROUPAMA PRUDENCE	1.139			123,45	140.648,63	129,88	147.969,89
FR0000290728	GROUPAMA COURT TERME	96			795,79	76.395,67	809,88	77.748,48
FR0010582452	GROUPAMA EONIA	74			211.028,88	15.670.793,44	211.373,26	15.696.366,92
FR0010213348	GROUPAMA CONVERTIBLES I D 4 DEC	270			2.765,02	746.556,40	2.657,61	717.554,70
FR0010298331	GR.ASIE I 4 DEC	557			1.271,14	708.026,14	2.247,02	1.251.590,14
FR0010636720	GROUPAMA ACT.EMERGENTES I 3DEC	120			3.662,15	439.458,00	3.880,92	465.710,40
FR0000981144	GROUPAMA ALTERN. EQUILIBRE	140			10.896,94	1.522.646,43	9.447,17	1.320.067,22
FR0000981151	GROUPAMA ALTERN.DYNAMIQUE	135			13.560,96	1.832.637,16	11.639,57	1.572.979,64
FR0010815654	GROUPAMA ALTERNATIF EQUILIBRE_SIDE POCKET	140			935,89	130.773,01	976,48	136.445,02
FR0010213298	ASTORG ACTIONS EURO I C(GR.EURO ST)	920			4.842,74	4.455.320,80	3.767,76	3.466.339,20
FR0000171985	ASTORG ACTIONS EUROPE I C(EX-GR.ACT. EUROPE ST	8.590			327,77	2.815.508,51	248,92	2.138.222,80
FR0000171852	EURO GAN D 4DEC	1.690			3.214,12	5.431.858,20	2.423,31	4.095.393,90
FR0010227306	GROUPAMA ALPHA EURO STOCK	1.146			10.868,52	12.455.328,67	10.468,60	11.997.015,60
FR0000296758	NRG JAPON SI	260			784.711,20	206.223,00	1.286,59	334.513,40
	sub-total	33.455	0,00			50.438.698,67		46.289.517,93
2.2.1.4 - De outros								
	...							
	sub-total	0	0,00			0,00		0,00
	sub-total 2.2.1	219.683,57	0,00			52.873.180,59		47.797.533,43
2.2.2 - Títulos de dívida								
2.2.2.1 - De dívida pública								
XS0223870907	HELLENIC REP FLOAT 07/24		1.800.000,00	99,00		1.782.000,00	48,20	867.621,85
DE0001135200	ALLEMAGNE 5% 04/07/2012		100.000,00	110,37		110.372,09	108,86	108.856,75
AT0000385745	AUTRICHE 4,65% 15/01/2018		4.700.000,00	111,33		5.232.479,00	115,16	5.412.656,49
BE0000306150	BELGIAN 3.75% 2015		3.931.000,00	99,18		3.898.826,04	103,50	4.068.732,54
BE0000318270	BELGIAN 3.75% 2020		4.000.000,00	103,42		4.136.775,00	99,26	3.970.550,14
BE0000315243	BELGIAN 4% 2019		1.050.000,00	97,49		1.023.629,00	104,40	1.096.195,54
BE0000300096	BELGIAN 5,50% 2017		200.000,00	114,97		229.934,00	112,73	225.450,90
BE0000307166	BELGIQUE 3.25% 2016		400.000,00	98,53		394.136,00	99,91	399.651,95
BE0000301102	BELGIQUE 4,25% 03/13		350.000,00	104,60		366.092,67	105,94	370.802,35
BE0000298076	BELGIQUE 5% 2012		200.000,00	112,87		225.743,00	106,38	212.759,34
BE0000310194	BELGIUM KINGDOM 4% 2013		1.200.000,00	106,30		1.275.592,00	106,92	1.283.022,90
BE0000291972	BELGIUM KINGDOM 5.5% 2028		1.700.000,00	115,30		1.960.054,00	118,61	2.016.285,70
BE0000312216	BGB 4% 2018		100.000,00	102,95		102.946,00	105,14	105.143,58
ES00000120J8	BONOS 3.8% 2017		4.200.000,00	101,26		4.253.099,00	97,38	4.089.936,94
ES0000012916	BONOS 4.4% 31/01/2015		1.700.000,00	107,30		1.824.083,00	104,63	1.778.663,95
ES00000121G2	BONOS 4.8% 2024		200.000,00	105,23		210.465,00	96,81	193.624,66
ES0000012783	BONOS 5.5% 2017		200.000,00	113,41		226.812,00	105,21	210.425,08
FR0116114978	BTNS 2.50% 2014		1.500.000,00	98,88		1.483.170,00	105,54	1.583.157,12
IT0004508971	BTPS 2.5% 2012		3.750.000,00	101,76		3.816.130,00	101,04	3.789.128,42
IT0004505076	BTPS 3.5% 2014		300.000,00	102,12		306.374,00	100,62	301.868,01
IT0004448863	BTPS 3.75% 2013		6.800.000,00	104,81		7.127.081,00	101,44	6.898.150,08
IT0004594930	BTPS 4% 2020		6.800.000,00	100,66		6.844.784,40	96,23	6.543.777,86
IT0004536949	BTPS 4,25% 2020		5.400.000,00	103,27		5.576.520,00	98,48	5.318.076,82

GROUPAMA SEGUROS DE VIDA, SA
INVENTÁRIO DE TÍTULOS E PARTICIPAÇÕES FINANCEIRAS

IDENTIFICAÇÃO DOS TÍTULOS	DESIGNAÇÃO	Quantidade	Montante do valor nominal	% do valor nominal	Preço médio de aquisição	Valor total de aquisição	Valor de balanço unitário	Total
IT0004489610	BTPS 4.25% 2019		3.400.000,00	100,32		3.411.014,00	99,21	3.373.238,73
IT0004361041	BTPS 4.5% 01/08/2018		40.000,00	100,12		40.049,20	102,55	41.018,79
IT0004423957	BTPS 4.5% 2019		2.779.000,00	97,60		2.712.222,92	101,56	2.822.262,94
IT0003644769	BTPS 4.5% 2020		300.000,00	101,67		305.018,00	101,06	303.176,92
IT0004532559	BTPS 5% 2040		4.000.000,00	102,02		4.080.712,00	96,15	3.845.901,37
IT0003256820	BTPS 5,75% 2033		530.000,00	116,54		617.652,40	107,23	568.327,06
IT0001174611	BTPS 6,5% 2027		1.350.000,00	117,65		1.588.311,60	115,29	1.556.475,66
IT0001086567	BTPS 7,25% 2026		40.000,00	125,31		50.124,20	123,65	49.459,11
IT000366655	BTPS 9% 2023		900.000,00	144,10		1.296.903,01	139,23	1.253.101,06
DE0001135374	DBR 3.75% 2019		5.700.000,00	102,53		5.844.150,00	111,04	6.329.046,53
FI4000010848	FINNISH GOVT 3.375% 2020		4.000.000,00	101,50		4.059.815,00	104,48	4.179.300,27
GR0124029639	GGB 4.3% 2017		100.000,00	102,15		102.151,00	63,18	63.182,05
GR0124026601	GRECE 3,70% 2015		1.550.000,00	101,78		1.577.613,00	69,11	1.071.204,47
GR0114020457	GRECE 4.1% 2012		1.000.000,00	103,91		1.039.135,00	89,68	896.789,73
GR0124015497	GRECE 5,35% 01/11		2.020.000,00	111,36		2.249.485,19	101,97	2.059.890,16
GR0133001140	GRECE 6,5% TF		430.000,00	119,54		514.029,10	67,22	289.025,69
GR0124030645	GREECE 4,6% 2018		901.000,00	93,44		841.873,76	63,04	567.962,02
GR0114022479	GREECE 5,50% 2014		2.500.000,00	101,29		2.532.178,00	78,31	1.957.852,74
GR0133002155	GREECE 5,90% 2022		1.000.000,00	124,65		1.246.523,00	65,13	651.315,07
GR0124028623	HELLENIC REP.3.6% 2016		820.000,00	99,40		815.079,10	64,37	527.813,78
GR0133003161	HELLENIC REP.4.7% 2024		1.500.000,00	96,31		1.444.684,00	61,69	925.316,10
GR0124031650	HELLENIC REPUBLIC 6% 2019		257.000,00	107,59		276.517,38	67,86	174.406,18
IT0001247243	ITALIE 011119 Z.C.		4.500.000,00	44,41		1.998.661,50	65,97	2.968.762,50
IT0003844534	ITALIE 3,75% 01/08/15		500.000,00	96,94		484.698,00	101,74	508.703,22
IT0003618383	ITALIE 4,25% 04/14		100.000,00	105,12		105.121,00	104,47	104.470,42
IT0003493258	ITALIE 4,25% 2019		5.870.000,00	99,12		5.818.519,52	100,35	5.890.629,22
IT0003242747	ITALIE 5,25% 2017		1.360.000,00	108,49		1.475.494,87	108,22	1.471.798,50
NL0006007239	NETHERLAND GOVT.4.5% 2017		400.000,00	113,61		454.445,00	113,57	454.270,25
NL0000102325	NETHERLANDS 3.75% 2014		980.000,00	104,99		1.028.885,40	109,54	1.073.475,25
NL0000102317	NETHERLANDS GOV.5.5% 2028		1.140.000,00	115,40		1.315.595,40	130,38	1.486.388,58
NL0009348242	NETHERLANDS GOVT 3.5% 2020		250.000,00	100,57		251.427,50	104,38	260.961,37
NL0000102283	NETHERLANDS GOVT 4% 2016		115.000,00	104,75		120.457,55	110,83	127.458,01
NL0006227316	NETHERLANDS GOVT 4% 2018		720.000,00	107,83		776.372,60	109,88	791.114,79
NL0009086115	NETHERLANDS GOVT 4% 2019		1.630.000,00	102,20		1.665.896,98	109,27	1.781.052,83
NL0000102234	NETHERLANDS GOVT 4% 2037		400.000,00	97,45		389.803,00	111,47	445.874,47
FR0010517417	O.A.T. 4.25% 2017		200.000,00	107,72		215.433,00	109,77	219.532,25
FR0010216481	OAT 3% 2015		7.900.000,00	100,53		7.941.910,00	104,04	8.218.819,11
FR0010163543	OAT 3.5% 25/04/2015		600.000,00	103,61		621.671,14	108,38	650.305,56
FR0010854182	OAT 3.5% 2020		1.550.000,00	100,43		1.556.606,00	104,00	1.612.035,03
FR0010415331	OAT 3.75% 2017		80.000,00	105,32		84.253,40	108,82	87.052,38
FR0010776161	OAT 3.75% 2019		5.829.000,00	102,49		5.974.091,12	104,77	6.106.998,68
FR0010112052	OAT 4% 25/10/2014		1.200.000,00	105,98		1.271.811,00	108,78	1.305.374,96
FR0010670737	OAT 4,25% 2018		7.380.000,00	105,75		7.803.989,40	109,38	8.071.979,51
FR0010466938	OAT 4.25% 2023		1.900.000,00	102,04		1.938.840,00	107,99	2.051.812,79
FR0010070060	OAT 4.75% 2035		800.000,00	108,00		863.963,00	116,99	935.907,32
FR0000187361	OAT 5%		950.000,00	105,18		999.200,00	114,20	1.084.917,07
FR0000188328	OAT 5% 25/04/2012		1.200.000,00	118,26		1.419.165,20	108,97	1.307.695,89
FR0000187874	OAT 5% 25/10/11		450.000,00	104,03		468.123,39	104,40	469.814,89
FR0000571218	OAT 5.50% 2029		1.400.000,00	117,41		1.643.802,00	125,97	1.763.595,73
FR0000187635	OAT 5.75% 2032		170.000,00	123,00		209.107,60	129,14	219.532,00
FR0000571150	OAT 6% 2025		890.000,00	120,98		1.076.694,30	127,83	1.137.708,09
AT0000A04967	REP.AUSTRIA 4.15% 2037		1.200.000,00	96,34		1.156.126,00	107,40	1.288.843,68
AT0000383864	REP.AUSTRIA 6.25% 2027		900.000,00	124,59		1.121.282,00	133,17	1.198.501,52
XS0369470397	REP.HUNGARY 5,75% 2018		800.000,00	102,09		816.749,01	96,05	768.415,56
ES00000121L2	SPANISH GOV 4.6% 2019		500.000,00	104,37		521.841,50	97,09	485.434,11
ES0000012866	SPANISH GOVT 4.2% 2013		1.200.000,00	105,40		1.264.743,00	102,79	1.233.516,66
ES0000012118	SPANISH GOVT. 2.75% 2012		3.000.000,00	101,37		3.040.950,00	100,97	3.028.976,71
ES0000012932	SPANISH GOVT.4.20% 2037		1.300.000,00	90,71		1.179.171,00	81,35	1.057.501,74
ES0000012411	SPANISH GOVT.5.75% 2032		1.100.000,00	112,94		1.242.316,00	99,93	1.099.241,30
ES00000121A5	SPGB 4.1% 2018		100.000,00	103,21		103.206,00	95,05	95.045,86
ES00000122E5	SPGB 4.65% 2025		2.000.000,00	101,22		2.024.480,00	90,11	1.802.218,36
		sub-total	0	148.262.000,00		151.497.241,44		149.016.341,57

GROUPAMA SEGUROS DE VIDA, SA
INVENTÁRIO DE TÍTULOS E PARTICIPAÇÕES FINANCEIRAS

IDENTIFICAÇÃO DOS TÍTULOS CÓDIGO	DESIGNAÇÃO	Quantidade	Montante do valor nominal	% do valor nominal	Preço médio de aquisição	Valor total de aquisição	Valor de balanço unitário	Total
2.2.2.2 - De outros emissores públicos								
XS0177566642	ASFINAG 4.125% 2013		350.000,00	107,01		374.526,00	106,31	372.075,92
FR0010767566	CAISSE AMORT DETTE 4.25% 2020		400.000,00	106,56		426.259,00	109,13	436.531,84
FR0010915660	CAISSE D'AMORT DETTE 3.375% 2021		640.000,00	102,95		658.895,70	99,92	639.472,75
FR0010163329	CAISSE D'AMORT.DETTE 3.625% 2015		400.000,00	107,12		428.486,00	107,74	430.975,51
FR0010198036	CAISSE D'AMORT.DETTE 3.75% 2020		200.000,00	100,00		200.003,00	102,52	205.034,71
FR0010143743	CAISSE D'AMORT.DETTE 4% 2019		550.000,00	98,57		542.126,00	104,96	577.270,35
FR0010456434	CAISSE D'AMORT.DETTE 4,125% 2017		1.190.000,00	110,79		1.318.456,60	109,50	1.303.066,10
FR0010347989	CAISSE D'AMORT.DETTE 4,375% 2021		100.000,00	103,96		103.955,00	107,59	107.594,07
FR0000473217	CAISSE NAT. DES AUTOR 4,5% 2018		1.000.000,00	97,35		973.500,00	111,48	1.114.763,98
FR0000483133	CAISSE NAT.DES AUTOR. 6% 2015		330.000,00	118,61		391.410,00	115,35	380.661,40
ES0315944001	CEAMI 3.125% 06/12		4.050.000,00	100,20		4.058.100,00	100,14	4.055.825,34
XS0342783692	EDF 5% 2018		300.000,00	99,33		297.992,00	112,97	338.915,52
XS0409744744	EDF 5.125% 2015		1.150.000,00	99,83		1.148.022,00	114,44	1.316.021,07
XS0500397905	FRANCE TEL 3.875% 2020		450.000,00	98,95		445.275,00	101,77	457.982,88
FR0000471948	FRANCE TEL 7.25%		360.000,00	116,28		418.600,00	117,30	422.272,20
ES0302761004	FUND ORD BNK 3% 2014		2.500.000,00	100,53		2.513.250,00	93,17	2.329.205,14
FR0000472326	GDF 4.75% 03/13		2.000.000,00	99,49		1.989.880,00	109,90	2.197.986,50
FR0010709279	GDF SUEZ 5,625% 2016		2.000.000,00	99,91		1.998.280,00	117,80	2.356.008,85
XS0340179307	GE 4.75% 01/18/11		1.850.000,00	95,60		1.768.600,00	104,60	1.935.112,78
XS0222473877	GPSS 3.375% 2016		100.000,00	99,93		99.933,00	105,33	105.326,25
XS0256171181	GPSS 4.25% 2017		300.000,00	108,39		325.157,00	110,29	330.877,50
XS0428962921	INST.CRD.T.OFLC 4.375% 2019		250.000,00	102,59		256.474,00	93,28	233.192,29
FR0010199927	SNCF 3.625% 2020		410.000,00	106,31		435.851,90	103,31	423.569,11
FR0000470288	SNCF 4,75% 02-12		2.074.000,00	99,92		2.072.438,21	106,48	2.208.310,53
XS0128139531	TELECOM ITALIA 01/11 TF		660.000,00	102,20		674.493,60	105,94	699.220,80
	sub-total	0	23.614.000,00			23.919.964,01		24.977.273,39
2.2.2.3 - De outros emissores								
XS0231203992	DANSKE BANK TV05/2020		3.000.000,00	98,97		2.969.169,00	94,66	2.839.929,63
XS0330119206	SNS BANK C.ZERO		8.844.000,00	67,84		5.999.690,14	82,94	7.335.611,58
XS0252366702	AIG 4,375% 26/04/2016 TF		4.800.000,00	100,19		4.808.998,75	96,98	4.655.260,27
XS0307512722	AIG 5% 26/06/2017		2.900.000,00	99,10		2.873.795,00	96,58	2.800.684,93
FR0010096123	AIR LIQUIDE 4,75% 06/2014		1.950.000,00	104,08		2.029.544,00	111,19	2.168.274,98
XS0211637839	ALLIANZ 4,375% TF/TV PERP.		4.980.000,00	93,48		4.655.534,00	91,80	4.571.622,96
XS0177448288	AVIVA PLC PERP CALL 29/09/15		4.780.000,00	103,59		4.951.593,00	85,95	4.108.521,32
XS0260057285	AXA CALL 2016 PERP.		2.550.000,00	102,01		2.601.298,81	87,82	2.239.340,56
XS0463097237	BANK NEDERLAND 3.875% 2019		300.000,00	100,76		302.273,00	103,87	311.622,38
FR0010015982	BANQ FED CRD MUT 5% 03-15		1.780.000,00	100,02		1.780.356,00	104,17	1.854.266,47
XS0342289575	BARCLAYS 6% 2018		2.500.000,00	99,83		2.495.625,00	105,61	2.640.189,70
XS0171786287	BAT INT FIN 5,125% 2013		1.200.000,00	106,18		1.274.109,00	109,74	1.316.870,31
ES0413211105	BBVA 3,5% 2020		200.000,00	98,22		196.443,00	84,67	169.332,14
XS0196448129	BEI 4.625% 2020		680.000,00	104,47		710.415,00	113,30	770.409,61
XS0308505055	BEI 4.75% 2017		50.000,00	114,00		57.000,00	111,54	55.769,53
XS0148310294	BEI 5.375% 2012		900.000,00	109,51		985.623,00	108,42	975.770,14
XS0069971710	BEI 96/16 TF		997.595,79	100,25		1.000.059,86	128,01	1.277.053,36
BE0932179097	BELGACOM 4,125% 2011		1.000.000,00	95,55		955.500,00	102,68	1.026.849,63
XS0171467854	BES FINANCE TF/TV 2014 PERP		3.500.000,00	103,16		3.610.692,00	51,78	1.812.382,46
XS0218324050	BFCM 4.471% 2015		350.000,00	96,55		337.936,00	82,78	289.743,84
XS0408730157	BMW US CAP 6.375% 2012		400.000,00	99,80		399.184,00	109,86	439.446,67
FR0010306738	BNP PARIBAS TF/TV 04/16 PERP		4.700.000,00	98,62		4.635.056,00	90,41	4.249.185,02
FR0000186058	BNP PARIBAS 4.30% 2011 TF		382.000,00	87,19		333.065,80	103,91	396.917,52
FR0010622753	BNP PARIBAS 4.75% 2013		1.000.000,00	97,31		973.123,00	109,35	1.093.469,73
FR0000186447	BNP PARIBAS 5,70% 2011 TF		739.000,00	96,85		715.705,30	103,66	766.075,75
FR0010212852	BOUYGUES 4.25% 2020		750.000,00	98,96		742.171,00	103,26	774.482,26
XS0125754324	BSCH 6% 2011		1.385.000,00	99,02		1.371.427,00	105,05	1.454.927,80
ES0414950628	CAJA MADRID 4% 03/02/2025		2.100.000,00	97,74		2.052.523,00	78,78	1.654.472,35
ES0314400120	CAJAME 2,875% 05/12		1.750.000,00	99,77		1.745.975,00	99,93	1.748.853,58
FR0010257873	CARREFOUR 3.625% 05/13		2.910.000,00	99,90		2.907.182,00	106,01	3.084.967,25
XS0167864544	CARREFOUR 4.375% 2011		360.000,00	97,70		351.716,40	103,83	373.794,78
FR0000188542	CCCC 6% 02-12 SENIOR		900.000,00	101,50		913.500,00	102,75	924.763,81
FR0010725549	CDC 4.125% 20/02/2019		1.000.000,00	99,55		995.523,00	108,33	1.083.276,40
FR0010242685	CIF EUROMORTGAGE 3,25% 2015		1.000.000,00	99,37		993.726,50	102,17	1.021.711,09
FR0010279273	CNCEP CALL PERP		1.000.000,00	79,95		799.523,00	81,33	813.335,62
FR0010117366	CNCEP TF/TV PERP		3.070.000,00	98,02		3.009.068,00	79,95	2.454.507,05
FR0010409789	CNP ASSURANCES TF/TV 12/2016 PERP		4.750.000,00	99,53		4.727.575,50	78,12	3.710.563,36
XS0164139767	COFINOGA CFNG TF/TV 2013 PERP		1.000.000,00	111,46		1.114.646,00	85,71	857.120,55
FR0000473993	COFIROUTE 5,25% 03-18		1.604.000,00	100,77		1.616.356,00	114,38	1.834.580,71
FR0000487217	COFIROUTE 5.875% 2016		1.760.000,00	119,64		2.105.710,00	113,47	1.997.141,67
FR0010261495	CRH 3.5% 2017		8.080.000,00	94,23		7.614.002,95	103,69	8.378.173,84

GROUPAMA SEGUROS DE VIDA, SA
INVENTÁRIO DE TÍTULOS E PARTICIPAÇÕES FINANCEIRAS

IDENTIFICAÇÃO DOS TÍTULOS CÓDIGO	DESIGNAÇÃO	Quantidade	Montante do valor nominal	% do valor nominal	Preço médio de aquisição	Valor total de aquisição	Valor de balanço unitário	Total
FR0010345181	CRH 4% 2018		1.200.000,00	94,87		1.138.396,90	106,03	1.272.392,71
DE0007787780	DEUTSCH BAHN 5,125% 2013		1.200.000,00	101,04		1.212.530,00	108,91	1.306.960,28
XS0164831843	DEUTSCH BAHN FIN 4,75% 2018		850.000,00	98,45		836.806,50	114,90	976.641,59
DE0009279042	DEUTSCH POST FIN 5,125% 2012		1.160.000,00	111,89		1.297.877,00	106,82	1.239.095,95
DE0003933263	DEUTSCHE BK 5,125% 03/13		1.500.000,00	99,50		1.492.500,00	108,59	1.628.912,30
DE000A0T5X07	DEUTSCHE TEL FIN 6% 2017		650.000,00	99,81		648.752,00	118,62	771.050,75
DE000A0TT2M2	DEUTSCHE TEL. 5,75% 2015		900.000,00	99,61		896.508,00	115,12	1.036.097,32
XS0284386306	DEXIA CREDIT L. TF/TV CALL 2019		9.050.000,00	99,78		9.030.354,64	100,15	9.063.808,80
XS0361244402	E.ON INT.FIN.5,125% 2013		700.000,00	99,82		698.756,00	110,61	774.247,47
XS0410299357	E.ON.INTL. 4,875% 2014		360.000,00	99,96		359.859,60	112,38	404.577,45
XS0256997007	EDP FINANCE 4,625% 2016		2.500.000,00	96,78		2.419.500,00	97,47	2.436.860,45
XS0253627136	ELM BV PERP CALL 25/05/16		5.350.000,00	99,04		5.298.518,50	88,02	4.708.963,30
XS0207320242	ENBW INT FIN 4,875% 04-25		795.000,00	99,28		789.242,50	108,26	860.645,48
XS0411044653	ENI SPA 5% 2016		750.000,00	99,34		745.027,50	112,50	843.713,92
FR0000495707	ENT.MINIERE CHIM 5,375%		500.000,00	107,19		535.950,00	112,97	564.829,76
NL0000117224	EUREKO TF/TV 06/49 perp		2.500.000,00	99,28		2.481.940,00	82,65	2.066.197,91
XS0460357550	EUROF 4 % 2021		360.000,00	109,03		392.498,00	103,65	373.155,58
DE000A0DLU69	EWE AG 4,875% 19102014		500.000,00	108,33		541.673,00	108,75	543.728,95
BE0932372080	FORTIS BQ 4,375% 2017		3.150.000,00	99,80		3.143.772,15	106,46	3.353.377,81
XS0257650019	FORTIS HYBRID TF CALL 2016		5.600.000,00	99,32		5.561.794,00	74,72	4.184.542,47
XS0363471805	GE CAP FUND 5,25% 2015		1.200.000,00	99,76		1.197.082,00	111,17	1.334.040,70
XS0256975458	GENERALI FINANCE TF/TV 06/16 PERP		6.000.000,00	99,84		5.990.122,00	89,18	5.351.057,45
XS0184927761	GOLDMAN SACHS 4,75%		3.800.000,00	101,73		3.865.740,00	107,66	4.091.141,42
FR0010612713	GROUPE DANONE 5,5% 2015		700.000,00	99,81		698.672,00	115,94	811.547,59
XS0335134705	GSK 5,625% 2017		100.000,00	103,29		103.290,00	113,79	113.790,90
XS0255242769	HBOS PERP CALL 05/16		200.000,00	100,01		200.023,00	67,00	134.000,00
XS0165449736	HBOS PLC 4,875%		1.000.000,00	99,90		999.008,00	97,95	979.468,63
XS0400006234	IBERDROLA FIN 7,5% 2015		500.000,00	107,54		537.715,00	115,37	576.863,48
XS0400002670	IBERDROLA FIN. 6,375% 2011		1.100.000,00	105,07		1.155.726,00	104,57	1.150.224,54
XS0429114530	IBRD 3,875% 2019		180.000,00	102,46		184.433,00	107,23	193.020,66
FR0010101857	IMERY S 5,125% 2014		1.900.000,00	101,68		1.931.989,00	107,92	2.050.409,20
XS0221619033	ING GROEP TF/TV 2015 PERP		3.450.000,00	94,72		3.267.978,00	80,42	2.774.485,36
XS0360809577	INTESA SANPAOLO 6,625% 2018		2.200.000,00	98,52		2.167.348,01	103,71	2.281.547,67
DE000A0L1CY5	KFW 3,875% 2019		300.000,00	101,10		303.290,00	108,53	325.581,19
DE000A0MFJX5	KFW 4,125% 2017		2.700.000,00	99,85		2.696.054,24	109,26	2.949.918,66
DE0002760790	KFW 5,125% 2013		200.000,00	109,93		219.857,00	111,46	222.912,19
FR0010301705	KLEPIERRE 4,25% 03/16		3.000.000,00	99,02		2.970.715,00	105,21	3.156.411,70
XS0353181190	KRAFT 6,25% 2018		1.000.000,00	99,55		995.530,00	117,52	1.175.187,71
FR0010397885	LA MONDIALE TF/TV CALL PERP.		2.500.000,00	98,79		2.469.796,00	70,69	1.767.187,50
FR0010021287	LA MONDIALE VIE PERPET.		4.300.000,00	106,01		4.558.614,00	85,52	3.677.165,61
FR0010032730	LAFARGE 5,448% 2013		1.000.000,00	100,00		1.000.000,00	107,01	1.070.129,29
FR0010178558	MACIFS TF/TV 2007/2015 PERP		1.900.000,00	97,08		1.844.566,00	77,18	1.466.459,56
XS0358344942	MORGAN STANLEY 6,5% 15/04/2011		1.850.000,00	100,30		1.855.550,00	105,92	1.959.485,53
XS0304987042	MUNICH RE TF/TV 2049		300.000,00	100,01		300.023,00	96,44	289.324,80
FR0010531012	NATIXIS TF/TV CALL 2017		3.000.000,00	99,27		2.978.116,00	83,03	2.490.860,38
XS0247626962	NATL GRID 4,125% 2013		2.600.000,00	98,34		2.556.721,00	107,58	2.797.051,14
XS0408880127	NATL GRID 6,5% 2014		1.800.000,00	99,58		1.792.357,50	116,83	2.102.912,63
XS0411735300	NOKIA 5,5% 2014		850.000,00	99,86		848.767,50	113,67	966.208,63
XS0234623626	OTE PLC 3,75% 2011		970.000,00	95,60		927.320,00	99,07	960.980,94
XS0364137272	OTP BANK 5,75% 2011		500.000,00	99,82		499.083,00	104,01	520.050,17
DE000A0GMHG2	PORSCHE 3,875% 2016		1.150.000,00	99,11		1.139.719,00	105,59	1.214.276,65
XS0215828830	PT 3,75% 03/12		1.125.000,00	90,98		1.023.470,00	103,77	1.167.457,07
XS0293707617	RABOBANK 4,125% 2012		400.000,00	99,79		399.163,00	106,50	426.018,68
XS0408832151	RABOBANK 4,375% 2014		2.510.000,00	99,75		2.503.699,90	110,22	2.766.406,07
XS0172751355	REPSOL 5% 2003/13		200.000,00	99,73		199.466,00	106,91	213.828,36
XS0332106805	RESEAU FERRE FR 4,45% 2017		450.000,00	111,62		502.311,00	108,44	487.982,34
XS0410174659	RESEAU FERRE FR 4,5% 2024		50.000,00	110,35		55.173,00	110,52	55.259,57
XS0415624393	ROCHE 4,625% 2013		790.000,00	99,57		786.618,80	109,77	867.154,41
XS0128842571	ROYAL BK SCOT 6% 2013		1.000.000,00	99,27		992.700,00	104,77	1.047.730,24
XS0398576263	ROYAL BK SCOTL.3,75% 2011		500.000,00	99,67		498.345,00	102,78	513.903,88
XS0147030554	RWE FINANCE 6,125% 2012		800.000,00	99,40		795.202,74	109,12	872.972,27
FR0010224337	SCHNEIDER ELECT 4%		1.400.000,00	99,23		1.389.242,00	105,81	1.481.314,46
XS0412968876	SHELL INT.4,5% 2016		840.000,00	99,74		837.774,00	111,83	939.365,10
XS0369461644	SIEMENS 5,625% 2018		4.300.000,00	101,39		4.359.776,01	117,78	5.064.343,26
FR0010094623	ST GOBAIN NEDERL. 5% 250414		347.000,00	103,51		359.188,37	109,86	381.216,51
FR0000186744	STE GENERALE 5,55% 2012 TF		352.000,00	95,63		336.617,60	107,47	378.301,73
XS0110673950	STE GENERALE 6,625% 2015TF		1.640.000,00	106,77		1.751.028,00	114,90	1.884.349,83
XS0254905846	TELECOM ITALIA SPA 4,75% 05/14		200.000,00	99,17		198.335,00	107,13	214.250,19
XS0241945236	TELEFONICA 3,75% 2011		660.000,00	95,81		632.313,00	103,60	683.739,92

GROUPAMA SEGUROS DE VIDA, SA
INVENTÁRIO DE TÍTULOS E PARTICIPAÇÕES FINANCEIRAS

IDENTIFICAÇÃO DOS TÍTULOS	DESIGNAÇÃO	Quantidade	Montante do valor nominal	% do valor nominal	Preço médio de aquisição	Valor total de aquisição	Valor de balanço unitário	Total
CODIGO								
XS0241946630	TELEFONICA 4,375% 02/16		1.700.000,00	99,32		1.688.385,00	105,46	1.792.742,68
XS0284891297	TELEFONICA 4,674% 07/02/14		1.000.000,00	100,00		1.000.023,00	108,04	1.080.433,92
XS0410258833	TELEFONICA 5,431% 2014		500.000,00	100,00		500.000,00	111,12	555.584,79
XS0162867880	TELEFONICA EUROPE 5,125% 03-13		400.000,00	99,66		398.620,00	109,70	438.784,64
XS0223268136	TELSTRA 3,875% 2015		100.000,00	89,81		89.805,02	105,56	105.562,64
XS0411606246	TOYOTA 5,25% 2012		1.650.000,00	99,74		1.645.677,00	108,72	1.793.938,57
XS0341224151	UBS 4,875% 2013		600.000,00	99,95		599.710,00	109,52	657.147,06
XS0357891620	UBS AG LONDON 5,375% 2011		883.000,00	99,75		880.792,50	104,83	925.659,07
XS0357283257	UBS TF/TV 2013 PERP		50.000,00	98,76		49.382,00	108,86	54.430,01
XS0207065110	UNICREDITO 4,375% 01/20		3.130.000,00	103,99		3.255.025,00	101,60	3.180.123,74
XS0126157287	UNICREDITO 6% 16/03/11		200.000,00	107,19		214.381,00	105,35	210.697,25
XS0405876326	VERIZON 7,625% 2011		2.310.000,00	99,84		2.306.396,40	106,04	2.449.582,80
XS0169888558	VODAFONE GROUP 5% 2003-06/2018		1.351.000,00	99,92		1.349.946,22	112,40	1.518.479,58
XS0408285913	VODAFONE GROUP PLC 6,25% 2016		270.000,00	99,76		269.343,90	119,71	323.225,51
XS0412447632	VW 5,625% 2012		505.000,00	99,66		503.262,80	109,25	551.711,24
XS0363479618	VW CREDIT 5,125% 2011		1.200.000,00	99,84		1.198.054,00	104,63	1.255.533,45
XS0267974037	ABN AMRO Bank 09/2021 TV		4.950.000,00	99,29		4.914.970,00	86,57	4.285.036,48
XS0249443879	BAC 2018		2.500.000,00	88,45		2.211.250,00	91,55	2.288.664,38
ES0213860036	BANCO SABADELL		700.000,00	97,26		680.796,00	70,63	494.434,85
XS0240949791	BARCLAYS E3M 20/04/2016		4.400.000,00	100,00		4.399.784,00	97,49	4.289.340,00
ES0214601017	CAJA FLOAT 03/15		500.000,00	99,71		498.555,00	77,16	385.813,72
XS0381969954	ESPIRITO SANTO PLC CZ		1.102.000,00	100,00		1.102.000,00	99,35	1.094.837,00
XS0210991807	IPBS FLOAT 15/02/35		1.510.000,00	78,00		1.177.800,00	61,37	926.626,85
XS0287008220	MERRILL LYNCH 16/02/2012		600.000,00	91,63		549.798,00	98,63	591.759,06
XS0283070554	SANTANDER FLOAT 2012		2.500.000,00	97,14		2.428.500,00	98,48	2.462.070,11
XS0267703352	UNICREDITO IT CALL 2011 TV		1.300.000,00	99,87		1.298.252,00	95,15	1.236.892,23
FR0010369637	VIVENDI FLOAT 03/10/2011		600.000,00	96,90		581.400,00	100,38	602.304,80
	sub-total	0	233.801.595,79			229.902.207,81		226.691.785,06
	sub-total 2.2.2	0	405.677.595,79			405.319.413,26		400.685.400,02
	sub-total 2.2	219.684	405.677.595,79			458.192.593,85		448.482.933,45
	2.3 - Derivados de negociação							
771011532901	CRH 3,5% 2017		4.100.000			14.905,00		-594.910,00
771011532903	FORTIS 01/02/2017		1.500.000			5.839,00		-228.785,00
771011532902	CRH 3,5% 2017		1.400.000			5.089,00		-203.140,00
	sub-total 2.3	0	7.000.000,00			25.833,00		-1.026.835,00
	2.4 - Derivados de cobertura							
	...							
	sub-total 2.4	0	0,00			0,00		0,00
	total 2	1.710.765	446.955.396			500.892.010		487.314.305
	3 - TOTAL GERAL							
		3.210.765	446.955.395,79			525.492.009,87		511.914.305,18