

FUNDO DE PENSÕES PPR - SGF ACÇÕES DINÂMICO

Valor Patrimonial Unitário em 31/07/2019 6,37058 EUR
N.º Unidades de Participação em circulação 404 227

| | Quantidade | Moeda | Cot. Moeda | Cot. Euro | Jur Dec | Valor (Euro) |
|---------------------------------------------------------------|------------|-------|------------|-----------|---------|------------------|
| 1 Valores mobiliários cotados | | | | | | |
| 11 Mercado cot. ofic. de B.V. Port. | | | | | | |
| 114 Acções | | | | | | |
| BES | 113 832,00 | EUR | | | | 0,00 |
| 12 Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE | | | | | | |
| 121 Títulos de dívida pública | | | | | | |
| EIB FLOAT 01/10/2022 GBP | 19 000,00 | GBP | 100,17 | 91,26 | 11,88 | 20 901,52 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 20 901,52 |
| 122 Outros fundos públicos e equiparados | | | | | | |
| EIB 1,125% 15/05/2020 NOK | 340 000,00 | NOK | 99,80 | 980,35 | 81,92 | 34 624,70 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 34 624,70 |
| 123 Obrigações diversas | | | | | | |
| OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021) | 5 000,00 | EUR | 100,00 | 100,00 | 79,51 | 5 079,51 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 5 079,51 |
| 124 Acções | | | | | | |
| ISHARES Eurostoxx Banks 30-15 | 3 544,00 | EUR | 8,38 | 8,38 | | 29 698,72 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 29 698,72 |
| 3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo | | | | | | |
| 31 Fundos harmonizados | | | | | | |
| BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov. | 283,65 | EUR | 181,44 | 181,44 | | 51 464,55 |
| Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return | 120,33 | EUR | 139,49 | 139,49 | | 16 784,83 |
| CANDRIAM Euro High Yield | 46,34 | EUR | 1 272,50 | 1 272,50 | | 58 963,83 |
| COBAS Lux SICAV Global Fund | 2,01 | EUR | 15 009,35 | 15 009,35 | | 30 129,77 |
| Central Fund Canada LTD | 4 377,00 | USD | 13,61 | 15,08 | | 53 774,71 |
| ETFS 5x Short USD Long EUR | 2 551,00 | EUR | 8,62 | 8,62 | | 21 997,27 |
| ETFS AGRICULTURE | 8 633,00 | EUR | 3,53 | 3,53 | | 30 461,54 |
| ETFS Copper | 1 462,00 | EUR | 22,17 | 22,17 | | 32 405,23 |
| FISHER EMERGING MARKETS EQ-EUR UH | 268,59 | EUR | 134,29 | 134,29 | | 36 069,22 |
| FUNDSMITH Equity Fund | 3 337,41 | EUR | 40,98 | 40,98 | | 136 770,73 |
| First Trust Eurozone ALPHADX | 990,00 | EUR | 31,02 | 31,02 | | 30 704,85 |
| HENDERSON Horizon Pan-European Alpha | 1 488,47 | EUR | 16,43 | 16,43 | | 24 455,63 |
| INRIS UCITS R Parus I EUR HD | 214,85 | EUR | 101,87 | 101,87 | | 21 886,67 |
| INVECO Pan European Structured Equity | 3 327,60 | EUR | 13,71 | 13,71 | | 45 621,40 |
| ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED | 1 124,00 | EUR | 45,81 | 45,81 | | 51 490,44 |
| Ishares MSCI Emerging Markets USD | 2 881,00 | EUR | 29,76 | 29,76 | | 85 738,56 |
| JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY | 6 086,48 | EUR | 13,41 | 13,41 | | 81 619,70 |
| L&G Emerging Markets Short Duration | 81 835,11 | EUR | 1,03 | 1,03 | | 84 347,44 |
| Lindsell Train - GL-Equity EUR | 105 071,69 | EUR | 1,35 | 1,35 | | 141 626,13 |
| Lyxor Bund 1X Inverse | 1 473,00 | EUR | 42,91 | 42,91 | | 63 206,43 |
| M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC | 7 703,41 | EUR | 10,36 | 10,36 | | 79 827,37 |
| MAN GLG European Inc Opportunities | 405,01 | EUR | 98,59 | 98,59 | | 39 929,84 |
| MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I | 20,49 | EUR | 1 176,59 | 1 176,59 | | 24 113,55 |
| Merrill Lynch Inv.Sol.-Marshall Wace TOPS | 140,60 | EUR | 138,34 | 138,34 | | 19 450,88 |
| ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR | 977,10 | EUR | 32,88 | 32,88 | | 32 126,98 |
| PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD | 1 408,00 | USD | 18,08 | 20,03 | | 22 979,71 |
| PIMCO GIS-INCOME FD (INST) | 2 538,38 | EUR | 14,03 | 14,03 | | 35 613,53 |
| Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund | 16 060,30 | EUR | 2,36 | 2,36 | | 37 902,30 |
| THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS | 1 692,00 | USD | 14,67 | 16,25 | | 22 414,13 |

| | | | | | | |
|------------|------------------------------------------------------|----------|-----|----------|----------|---------------------|
| | US NATURAL GAS FUND LP | 1 135,00 | USD | 19,44 | 21,54 | 19 917,53 |
| | VECTOR FUND - NAVIGATOR -I1 | 77,01 | EUR | 1 780,14 | 1 780,14 | 137 092,14 |
| | Vaneck Vectors Gold Miners | 1 798,00 | USD | 26,50 | 29,36 | 43 010,95 |
| | Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit | | | | | |
| | Fund | 324,86 | EUR | 108,56 | 108,56 | 35 266,26 |
| | Winton Diversified Fund UC- EUR | 238,71 | EUR | 104,13 | 104,13 | 24 856,23 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 1 674 020,33 |
| 4 | Imobiliário | | | | | |
| 42 | U. P.'s de fundos de investimento imobiliário | | | | | |
| | CA Património Crescente | 2 026,00 | EUR | 17,20 | 17,20 | 34 837,88 |
| | SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN | 285,00 | EUR | 9,13 | 9,13 | 2 602,05 |
| | SEB Immoinvest | 360,00 | EUR | 4,51 | 4,51 | 1 623,60 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 39 063,53 |
| 5 | Liquidez | | | | | |
| 51 | À vista | | | | | |
| 512 | Depósitos à ordem | | | | | |
| | BBVA - € | | EUR | | | 3 183,53 |
| | CGD-EUR | | EUR | | | 669 657,50 |
| | Cx. Crédito Agrícola Mútuo | | EUR | | | 5,02 |
| | Millenium bcp | | EUR | | | 143 008,08 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 815 854,13 |
| 52 | A prazo | | | | | |
| 521 | Depósitos e outros equiparados | | | | | |
| | Millenium GBP | | GBP | | | -20 946,63 |
| | SUB-TOTAL | | | | | -20 946,63 |
| 9 | Outros valores a regularizar | | | | | -23 134,04 |
| | TOTAL DE APLICAÇÕES | | | | | 2 598 295,81 |
| | TOTAL DO FUNDO | | | | | 2 575 161,77 |

Lisboa, 31 de Julho de 2019