

FUNDO DE PENSÕES PPR - PATRIMÓNIO REFORMA CONSERVADOR

Valor Patrimonial Unitário em 30/11/2018 6,86343 EUR
N.º Unidades de Participação em circulação 548 229

1	Valores mobiliários cotados						
11	Mercado cot. ofic. de B.V. Port.						
114	Acções						
12	Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE						
	BES	309 682,00	EUR				0,00
121	Títulos de dívida pública						
	UK TSY 1,75% 22/07/2019	35 400,00	GBP	100,61	89,29	250,53	40 381,37
	SUB-TOTAL						40 381,37
122	Outros fundos públicos e equiparados						
	EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	860 000,00	NOK	99,79	970,75	542,26	88 767,26
	SUB-TOTAL						88 767,26
123	Obrigações diversas						
	ESF 6.875% 10/2019	100 000,00	EUR	0,11	0,11		111,00
	OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	100 000,00	EUR	100,00	100,00	595,89	100 595,89
	SUB-TOTAL						100 706,89
3	U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31	Fundos harmonizados						
	BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	1 783,23	EUR	165,93	165,93		295 891,52
	Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	426,58	EUR	136,92	136,92		58 407,33
	CANDRIAM Euro High Yield	75,84	EUR	1 183,05	1 183,05		89 720,15
	COBAS Lux SICAV Global Fund	1,14	EUR	16 955,83	16 955,83		19 307,60
	Central Fund Canada LTD	6 557,00	USD	11,73	13,27		67 963,17
	ETF WTI CRUDE OIL (EUR)	2 292,00	EUR	6,67	6,67		15 285,35
	ETFS 5x Short USD Long EUR	2 551,00	EUR	10,83	10,83		27 617,13
	ETFS AGRICULTURE	5 181,00	EUR	3,70	3,70		19 161,93
	ETFS Copper	851,00	EUR	22,63	22,63		19 253,88
	FISHER EMERGING MARKETS EQ-EUR UH	233,40	EUR	123,23	123,23		28 762,37
	FUNDSMITH Equity Fund	2 510,31	EUR	34,71	34,71		87 132,86
	First Trust Eurozone ALPHADX	697,00	EUR	28,59	28,59		19 927,23
	H2O MODERATO-IC	0,90	EUR	85 973,46	85 973,46		77 616,84
	HENDERSON Horizon Pan-European Alpha	3 957,83	EUR	15,95	15,95		63 127,39
	INRIS UCITS R Parus I EUR HD	601,61	EUR	104,10	104,10		62 627,60
	INVESCO Pan European Structured Equity	3 553,89	EUR	12,69	12,69		45 098,86
	ISHARES MSCI Emerging Markets ETF	327,00	USD	41,08	46,49		11 869,94
	ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	630,00	EUR	47,94	47,94		30 202,20
	ISHARES S&P 500 EUR	337,00	EUR	61,16	61,16		20 609,91
	Ishares NASDAQ 100 USD	30,00	EUR	339,55	339,55		10 186,50
	JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	4 104,18	EUR	12,42	12,42		50 973,92
	Jupiter Dynamic Bond Fund	17 700,58	EUR	10,29	10,29		182 138,97
	KEMPEN Euro Credit	97,17	EUR	1 389,47	1 389,47		135 014,80
	L&G Emerging Markets Short Duration	85 909,57	EUR	0,96	0,96		82 413,05
	La Française Euro Inflation	94,85	EUR	1 728,78	1 728,78		163 981,87
	Lindsell Train - GL-Equity EUR	58 882,91	EUR	1,14	1,14		66 949,87
	Lyxor BTP 10Y	315,00	EUR	127,35	127,35		40 115,25
	Lyxor Bund 1X Inverse	3264	EUR	46,61	46,61		152141,57
	M&G Optimal Income Fd C-H	9 788,01	EUR	20,61	20,61		201 723,06
	MAN GLG European Inc Opportunities	466,31	EUR	92,49	92,49		43 128,83
	MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I	28,24	EUR	1 157,98	1 157,98		32 703,39
	ML AQR Global Relative Value	663,03	EUR	100,65	100,65		66 733,77

	Merrill Lynch Inv.Sol.-Marshall Wace TOPS	452,34	EUR	133,27	133,27	60 283,22
	ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	605,39	EUR	34,44	34,44	20 849,75
	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	1 527,00	USD	14,36	16,25	19 375,99
	PIMCO FD-LD GLB IGR C- IEURHA	17 397,08	EUR	10,38	10,38	180 581,73
	PIMCO GIS-INCOME FD (INST)	13 542,34	EUR	13,29	13,29	179 977,73
	ROBECO BP US PREM EQ.-IHEUR	175,25	EUR	242,72	242,72	42 537,00
	STEWART Investors Asia Pacific Leaders	11 305,43	EUR	2,26	2,26	25 598,89
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	1 710,00	USD	14,15	16,01	21 380,75
	VECTOR FUND - NAVIGATOR -I1	58,49	EUR	1 658,96	1 658,96	97 027,59
	Vaneck Vectors Gold Miners	1 481,00	USD	19,09	21,60	24 982,24
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 141,85	EUR	105,52	105,52	120 487,91
	Winton Diversified Fund UC- EUR	429,68	EUR	105,26	105,26	45 229,40
	SUB-TOTAL					3 126 100,31
32	Fundos não harmonizados					
	BANIF Global Private Equity Fund - FCR	171 666,67	EUR	0,19	0,19	32 062,40
	SUB-TOTAL					32 062,40
4	Imobiliário					
42	U. P.'s de fundos de investimento imobiliário					
	CA Património Crescente	10 783,00	EUR	16,51	16,51	178 010,08
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	6 003,00	EUR	11,69	11,69	70 175,07
	SEB Immoinvest	4 969,00	EUR	5,35	5,35	26 589,12
	SUB-TOTAL					274 774,27
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			18 384,09
	BBVA-USD		USD			21,92
	CGD-EUR		EUR			55 148,72
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			72,97
	Millenium bcp		EUR			35 093,89
	SUB-TOTAL					108 721,59
52	A prazo					
521	Depósitos e outros equiparados					
9	Outros valores a regularizar		EUR			-8 786,53
	TOTAL DE APLICAÇÕES					3 771 514,09
	TOTAL DO FUNDO					3 762 727,56

Lisboa, 30 de Novembro de 2018