

FUNDO DE PENSÕES PPR - PATRIMÓNIO REFORMA EQUILIBRADO

Valor Patrimonial Unitário em 31/08/2018 6,20846 EUR
N.º Unidades de Participação em circulação 511 538

| | | | | | | | |
|------------|--|------------|-----|-----------|-----------|--------|------------------|
| 1 | Valores mobiliários cotados | | | | | | |
| 11 | Mercado cot. ofic. de B.V. Port. | | | | | | |
| 114 | Acções | | | | | | |
| | BES | 269 682,00 | EUR | | | | 0,00 |
| 12 | Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE | | | | | | |
| 121 | Títulos de dívida pública | | | | | | |
| | UK TSY 1,75% 22/07/2019 | 28 200,00 | GBP | 100,90 | 90,33 | 60,41 | 31 843,93 |
| | SUB-TOTAL | | | | | | 31 843,93 |
| 122 | Outros fundos públicos e equiparados | | | | | | |
| | EIB 0% 27/08/2021 | 170 000,00 | BRL | 78,33 | 368,49 | | 28 303,26 |
| | EIB 1,125% 15/05/2020 NOK | 600 000,00 | NOK | 99,87 | 971,48 | 205,32 | 61 803,90 |
| | SUB-TOTAL | | | | | | 90 107,16 |
| 123 | Obrigações diversas | | | | | | |
| | OREY Best Of 2027 (ex-2018, ex-2021) | 60 000,00 | EUR | 100,00 | 100,00 | 133,15 | 60 133,15 |
| | SUB-TOTAL | | | | | | 60 133,15 |
| 3 | U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo | | | | | | |
| 31 | Fundos harmonizados | | | | | | |
| | AXA Global Inflation Short Duration | 1 123,43 | EUR | 99,37 | 99,37 | | 111 635,14 |
| | BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov. | 1 389,65 | EUR | 165,74 | 165,74 | | 230 320,92 |
| | Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return | 247,19 | EUR | 136,62 | 136,62 | | 33 771,10 |
| | CANDRIAM Euro High Yield | 63,49 | EUR | 1 204,31 | 1 204,31 | | 76 466,46 |
| | COBAS Lux SICAV Global Fund | 1,53 | EUR | 19 160,52 | 19 160,52 | | 29 284,94 |
| | Central Fund Canada LTD | 6 356,00 | USD | 11,75 | 13,63 | | 64 376,75 |
| | ETFS AGRICULTURE | 7 675,00 | EUR | 3,59 | 3,59 | | 27 518,71 |
| | ETFS Copper | 1 361,00 | EUR | 21,33 | 21,33 | | 29 023,33 |
| | FISHER EMERGING MARKETS EQ-EUR UH | 372,36 | EUR | 129,28 | 129,28 | | 48 138,57 |
| | FUNDSMITH Equity Fund | 4 348,78 | EUR | 35,53 | 35,53 | | 154 512,15 |
| | First Trust Eurozone ALPHADX | 919,00 | EUR | 32,68 | 32,68 | | 30 032,92 |
| | H2O MODERATO-IC | 0,67 | EUR | 80 746,65 | 80 746,65 | | 54 294,05 |
| | HENDERSON Horizon Pan-European Alpha | 1 821,04 | EUR | 16,70 | 16,70 | | 30 411,42 |
| | INRIS UCITS R Parus I EUR HD | 427,04 | EUR | 106,68 | 106,68 | | 45 556,41 |
| | INVESCO Pan European Structured Equity | 3 111,73 | EUR | 14,02 | 14,02 | | 43 626,45 |
| | ISHARES MSCI Emerging Markets ETF | 401,00 | USD | 43,17 | 50,08 | | 14 922,23 |
| | ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED | 669,00 | EUR | 49,55 | 49,55 | | 33 148,95 |
| | ISHARES S&P 500 EUR | 539,00 | EUR | 65,09 | 65,09 | | 35 082,97 |
| | JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY | 7 767,62 | EUR | 12,67 | 12,67 | | 98 415,75 |
| | Jupiter Dynamic Bond Fund | 10 226,00 | EUR | 10,61 | 10,61 | | 108 497,86 |
| | KEMPEN Euro Credit | 43,96 | EUR | 1 402,17 | 1 402,17 | | 61 639,39 |
| | L&G Emerging Markets Short Duration | 102 073,42 | EUR | 0,96 | 0,96 | | 98 072,14 |
| | Lyxor BTP 10Y | 248,00 | EUR | 124,82 | 124,82 | | 30 955,36 |
| | Lyxor Bund 1X Inverse | 1 357,00 | EUR | 46,95 | 46,95 | | 63 715,22 |
| | M&G Optimal Income Fd C-H | 8 657,60 | EUR | 21,06 | 21,06 | | 182 300,38 |
| | MAN GLG European Inc Opportunities | 505,56 | EUR | 100,01 | 100,01 | | 50 561,06 |
| | MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I | 24,86 | EUR | 1 260,85 | 1 260,85 | | 31 350,55 |
| | ML AQR Global Relative Value | 303,08 | EUR | 106,87 | 106,87 | | 32 390,05 |
| | Merrill Lynch Inv.Sol.-Marshall Wace TOPS | 216,93 | EUR | 145,88 | 145,88 | | 31 645,02 |
| | ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR | 798,02 | EUR | 35,34 | 35,34 | | 28 201,98 |
| | PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD | 1 925,00 | USD | 15,36 | 17,82 | | 25 487,62 |
| | PIMCO FD-LD GLB IGR C- IEURHA | 14 534,83 | EUR | 10,45 | 10,45 | | 151 888,96 |

| | | | | | | |
|------------|--|------------|-----|----------|----------|---------------------|
| | PIMCO GIS-INCOME FD (INST) | 9 960,58 | EUR | 13,39 | 13,39 | 133 372,15 |
| | ROBECO BP GLOBAL PREMIUM EQUITIES IH EUR | 268,47 | EUR | 114,96 | 114,96 | 30 862,87 |
| | ROBECO BP US PREM EQ.-IHEUR | 241,25 | EUR | 262,72 | 262,72 | 63 382,09 |
| | STEWART Investors Asia Pacific Leaders | 14 633,90 | EUR | 2,32 | 2,32 | 33 919,92 |
| | THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS | 2 071,00 | USD | 15,80 | 18,33 | 28 206,19 |
| | VECTOR FUND - NAVIGATOR -I1 | 92,70 | EUR | 1 755,64 | 1 755,64 | 162 739,05 |
| | Vaneck Vectors Gold Miners | 2 427,00 | USD | 18,55 | 21,52 | 38 807,97 |
| | Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund | 622,20 | EUR | 106,75 | 106,75 | 66 419,85 |
| | Winton Diversified Fund UC- EUR | 476,85 | EUR | 105,90 | 105,90 | 50 496,72 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 2 695 451,62 |
| 32 | Fundos não harmonizados | | | | | |
| | BANIF Global Private Equity Fund - FCR | 178 333,32 | EUR | 0,17 | 0,17 | 31 174,54 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 31 174,54 |
| 4 | Imobiliário | | | | | |
| 42 | U. P.'s de fundos de investimento imobiliário | | | | | |
| | CA Património Crescente | 7 437,00 | EUR | 16,36 | 16,36 | 121 634,37 |
| | SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN | 1 500,00 | EUR | 15,31 | 15,31 | 22 965,00 |
| | SEB Immoinvest | 3 410,00 | EUR | 5,09 | 5,09 | 17 350,08 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 161 949,45 |
| 5 | Liquidez | | | | | |
| 51 | À vista | | | | | |
| 512 | Depósitos à ordem | | | | | |
| | BBVA - € | | EUR | | | 4 932,31 |
| | CGD-EUR | | EUR | | | 69 042,34 |
| | Cx. Crédito Agrícola Mútuo | | EUR | | | 46,87 |
| | Millenium bcp | | EUR | | | 40 290,92 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 114 312,44 |
| 52 | A prazo | | | | | |
| 521 | Depósitos e outros equiparados | | | | | |
| 9 | Outros valores a regularizar | | EUR | | | -9 111,72 |
| | TOTAL DE APLICAÇÕES | | | | | 3 184 972,29 |
| | TOTAL DO FUNDO | | | | | 3 175 860,57 |

Lisboa, 31 de Agosto de 2018