

FUNDO DE PENSÕES PPR - PATRIMÓNIO REFORMA PRUDENTE

Valor Patrimonial Unitário em 31/08/2018 1,40881 EUR
N.º Unidades de Participação em circulação 4 195 485

1	Valores mobiliários cotados								
11	Mercado cot. ofic. de B.V. Port.								
114	Acções								
	BES	245 999,00	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	50 500,00	GBP	100,90	90,33	108,18			57 025,48
	SUB-TOTAL								57 025,48
122	Outros fundos públicos e equiparados								
	EIB 0% 27/08/2021	315 000,00	BRL	78,33	368,49				52 444,27
	EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	1 050 000,00	NOK	99,87	971,48	359,31			108 156,83
	SUB-TOTAL								160 601,10
123	Obrigações diversas								
	ESF 6.875% 10/2019	100 000,00	EUR	0,11	0,11				111,00
	OREY Best Of 2027 (ex-2018, ex-2021)	75 000,00	EUR	100,00	100,00	166,44			75 166,44
	SUB-TOTAL								75 277,44
3	U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo								
31	Fundos harmonizados								
	AXA Global Inflation Short Duration	2 516,10	EUR	99,37	99,37				250 024,46
	BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 732,43	EUR	165,74	165,74				452 872,78
	Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	554,28	EUR	136,62	136,62				75 725,73
	Bluebay GLB SOV OPP-M EUR	405,18	EUR	104,58	104,58				42 373,52
	CANDRIAM Euro High Yield	120,59	EUR	1 204,31	1 204,31				145 221,72
	COBAS Lux SICAV Global Fund	1,29	EUR	19 160,52	19 160,52				24 665,34
	Central Fund Canada LTD	7 062,00	USD	11,75	13,63				71 527,47
	ETFS AGRICULTURE	6 622,00	EUR	3,59	3,59				23 743,18
	ETFS Copper	1 270,00	EUR	21,33	21,33				27 082,75
	FISHER EMERGING MARKETS EQ-EUR UH	321,04	EUR	129,28	129,28				41 504,57
	FUNDSMITH Equity Fund	4 236,48	EUR	35,53	35,53				150 522,13
	First Trust Eurozone ALPHADX	824,00	EUR	32,68	32,68				26 928,32
	GROUPAMA Trésorerie IC	7,24	EUR	40 294,38	40 294,38				291 896,52
	H2O MODERATO-IC	1,28	EUR	80 746,66	80 746,66				103 444,55
	HENDERSON Horizon Pan-European Alpha	5 284,60	EUR	16,70	16,70				88 252,79
	INRIS UCITS R Parus I EUR HD	681,24	EUR	106,68	106,68				72 674,15
	INVESCO Pan European Structured Equity	5 027,95	EUR	14,02	14,02				70 491,86
	ISHARES MSCI Emerging Markets ETF	354,00	USD	43,17	50,08				13 173,24
	ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	876,00	EUR	49,55	49,55				43 405,80
	ISHARES S&P 500 EUR	469,00	EUR	65,09	65,09				30 526,74
	JP MORGAN Global Corporate Bond	464,24	EUR	95,91	95,91				44 525,45
	JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	8 341,92	EUR	12,67	12,67				105 692,13
	Jupiter Dynamic Bond Fund	24 601,00	EUR	10,61	10,61				261 016,61
	KEMPEN Euro Credit	100,13	EUR	1 402,17	1 402,17				140 399,28
	L&G Emerging Markets Short Duration	117 994,20	EUR	0,96	0,96				113 368,83
	Lyxor BTP 10Y	466,00	EUR	124,82	124,82				58 166,12
	Lyxor Bund 1X Inverse	2 543,00	EUR	46,95	46,95				119 401,48
	M&G Optimal Income Fd C-H	15 507,86	EUR	21,06	21,06				326 544,27
	MAN GLG European Inc Opportunities	721,86	EUR	100,01	100,01				72 193,12
	MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I	30,66	EUR	1 260,85	1 260,85				38 661,59
	ML AQR Global Relative Value	784,73	EUR	106,87	106,87				83 863,67
	Merrill Lynch Inv.Sol.-Marshall Wace TOPS	674,44	EUR	145,88	145,88				98 387,60

	NATIXIS TRESORERIE - IC	7,95	EUR	12 513,37	12 513,37	99 481,29
	ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	715,47	EUR	35,34	35,34	25 284,53
	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	1 682,00	USD	15,36	17,82	22 270,22
	PIMCO FD-LD GLB IGR C- IEURHA	26 889,98	EUR	10,45	10,45	281 000,25
	PIMCO GIS-INCOME FD (INST)	20 819,06	EUR	13,39	13,39	278 767,20
	ROBECO BP GLOBAL PREMIUM EQUITIES IH EUR	241,37	EUR	114,96	114,96	27 747,44
	ROBECO BP US PREM EQ.-IHEUR	212,19	EUR	262,72	262,72	55 747,42
	STEWART Investors Asia Pacific Leaders	12 615,43	EUR	2,32	2,32	29 241,31
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	1 852,00	USD	15,80	18,33	25 223,50
	VECTOR FUND - NAVIGATOR -I1	97,28	EUR	1 755,64	1 755,64	170 779,88
	Vaneck Vectors Gold Miners	2 246,00	USD	18,55	21,52	35 913,76
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 533,08	EUR	106,75	106,75	163 656,29
	Winton Diversified Fund UC- EUR	830,72	EUR	105,90	105,90	87 970,24
	SUB-TOTAL					4 811 361,10
32	Fundos não harmonizados					
	BANIF Global Private Equity Fund - FCR	232 666,72	EUR	0,17	0,17	40 672,59
	SUB-TOTAL					40 672,59
4	Imobiliário					
42	U. P.'s de fundos de investimento imobiliário					
	CA Património Crescente	14 808,00	EUR	16,36	16,36	242 189,28
	SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN	2 400,00	EUR	15,31	15,31	36 744,00
	SEB Immoinvest	8 105,00	EUR	5,09	5,09	41 238,24
	SUB-TOTAL					320 171,52
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - EUR		EUR			25 788,48
	BBVA - €		EUR			-9 192,64
	BBVA-USD		USD			23,15
	CGD-EUR		EUR			231 417,41
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			100,69
	Millenium bcp		EUR			212 414,97
	SUB-TOTAL					460 552,06
52	A prazo					
521	Depósitos e outros equiparados					
9	Outros valores a regularizar		EUR			-15 040,56
	TOTAL DE APLICAÇÕES					5 925 661,29
	TOTAL DO FUNDO					5 910 620,73

Lisboa, 31 de Agosto de 2018