

FUNDO DE PENSÕES PPR - SGF ACÇÕES DINÂMICO

Valor Patrimonial Unitário em 31/08/2018 6,32904 EUR
N.º Unidades de Participação em circulação 259 369

| | 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 | | | | | | |
| UK TSY 1,75% 22/07/2019 | 13 500,00 | GBP | 100,90 | 90,33 | 28,92 | 15 244,44 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 15 244,44 |
| 122 Outros fundos públicos e equiparados | | | | | | |
| EIB 0% 27/08/2021 | 85 000,00 | BRL | 78,33 | 368,49 | | 14 151,63 |
| EIB 1,125% 15/05/2020 NOK | 320 000,00 | NOK | 99,87 | 971,48 | 109,50 | 32 962,08 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 47 113,71 |
| 123 Obrigações diversas | | | | | | |
| OREY Best Of 2027 (ex-2018, ex-2021) | 5 000,00 | EUR | 100,00 | 100,00 | 11,10 | 5 011,10 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 5 011,10 |
| 3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo | | | | | | |
| 31 Fundos harmonizados | | | | | | |
| AXA Global Inflation Short Duration | 165,96 | EUR | 99,37 | 99,37 | | 16 491,45 |
| BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov. | 283,65 | EUR | 165,74 | 165,74 | | 47 011,32 |
| Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return | 120,33 | EUR | 136,62 | 136,62 | | 16 439,48 |
| CANDRIAM Euro High Yield | 46,34 | EUR | 1 204,31 | 1 204,31 | | 55 804,11 |
| COBAS Lux SICAV Global Fund | 1,53 | EUR | 19 160,52 | 19 160,52 | | 29 357,75 |
| Central Fund Canada LTD | 3 969,00 | USD | 11,75 | 13,63 | | 40 200,02 |
| ETFS AGRICULTURE | 4 523,00 | EUR | 3,59 | 3,59 | | 16 217,22 |
| ETFS Copper | 1 057,00 | EUR | 21,33 | 21,33 | | 22 540,53 |
| FISHER EMERGING MARKETS EQ-EUR UH | 239,76 | EUR | 129,28 | 129,28 | | 30 995,53 |
| FUNDSMITH Equity Fund | 3 633,06 | EUR | 35,53 | 35,53 | | 129 082,62 |
| First Trust Eurozone ALPHADX | 990,00 | EUR | 32,68 | 32,68 | | 32 353,20 |
| H2O MODERATO-IC | 0,38 | EUR | 80 746,66 | 80 746,66 | | 30 683,73 |
| HENDERSON Horizon Pan-European Alpha | 1 488,47 | EUR | 16,70 | 16,70 | | 24 857,52 |
| INRIS UCITS R Parus I EUR HD | 214,85 | EUR | 106,68 | 106,68 | | 22 920,09 |
| INVESCO Pan European Structured Equity | 3 327,60 | EUR | 14,02 | 14,02 | | 46 652,95 |
| ISHARES MSCI Emerging Markets ETF | 687,00 | USD | 43,17 | 50,08 | | 25 565,01 |
| ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED | 648,00 | EUR | 49,55 | 49,55 | | 32 108,40 |
| ISHARES S&P 500 EUR | 265,00 | EUR | 65,09 | 65,09 | | 17 248,59 |
| Ishares NASDAQ 100 USD | 50,00 | EUR | 366,90 | 366,90 | | 18 345,00 |
| JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY | 4 238,91 | EUR | 12,67 | 12,67 | | 53 706,99 |
| L&G Emerging Markets Short Duration | 81 835,11 | EUR | 0,96 | 0,96 | | 78 627,17 |
| Lyxor BTP 10Y | 129,00 | EUR | 124,82 | 124,82 | | 16 101,78 |
| Lyxor Bund 1X Inverse | 706,00 | EUR | 46,95 | 46,95 | | 33 148,82 |
| M&G Optimal Income Fd C-H | 2 507,10 | EUR | 21,06 | 21,06 | | 52 791,32 |
| MAN GLG European Inc Opportunities | 354,88 | EUR | 100,01 | 100,01 | | 35 491,95 |
| MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I | 18,95 | EUR | 1 260,85 | 1 260,85 | | 23 888,08 |
| ML AQR Global Relative Value | 191,03 | EUR | 106,87 | 106,87 | | 20 415,80 |
| Merrill Lynch Inv.Sol.-Marshall Wace TOPS | 140,60 | EUR | 145,88 | 145,88 | | 20 511,02 |
| ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR | 854,81 | EUR | 35,34 | 35,34 | | 30 209,02 |
| PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD | 1 408,00 | USD | 15,36 | 17,82 | | 18 642,37 |
| PIMCO GIS-INCOME FD (INST) | 2 393,46 | EUR | 13,39 | 13,39 | | 32 048,39 |
| ROBEKO BP GLOBAL PREMIUM EQUITIES IH EUR | 246,05 | EUR | 114,96 | 114,96 | | 28 285,41 |
| ROBEKO BP US PREM EQ.-IHEUR | 186,31 | EUR | 262,72 | 262,72 | | 48 948,26 |

| | | | | | | |
|------------|--|----------|-----|----------|----------|---------------------|
| | STEWART Investors Asia Pacific Leaders | 9 686,50 | EUR | 2,32 | 2,32 | 22 452,35 |
| | THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS | 1 692,00 | USD | 15,80 | 18,33 | 23 044,36 |
| | US NATURAL GAS FUND LP | 1 343,00 | USD | 23,95 | 27,78 | 27 726,10 |
| | VECTOR FUND - NAVIGATOR -I1 | 84,51 | EUR | 1 755,64 | 1 755,64 | 148 374,40 |
| | Vaneck Vectors Gold Miners | 2 405,00 | USD | 18,55 | 21,52 | 38 456,19 |
| | Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund | 296,90 | EUR | 106,75 | 106,75 | 31 694,50 |
| | Winton Diversified Fund UC- EUR | 238,71 | EUR | 105,90 | 105,90 | 25 278,75 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 1 464 717,55 |
| 4 | Imobiliário | | | | | |
| 42 | U. P.'s de fundos de investimento imobiliário | | | | | |
| | CA Património Crescente | 2 026,00 | EUR | 16,36 | 16,36 | 33 135,84 |
| | SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN | 285,00 | EUR | 15,31 | 15,31 | 4 363,35 |
| | SEB Immoinvest | 360,00 | EUR | 5,09 | 5,09 | 1 831,68 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 39 330,87 |
| 5 | Liquidez | | | | | |
| 51 | À vista | | | | | |
| 512 | Depósitos à ordem | | | | | |
| | BBVA - € | | EUR | | | 815,39 |
| | CGD-EUR | | EUR | | | 26 911,20 |
| | Cx. Crédito Agrícola Mútuo | | EUR | | | 5,02 |
| | Millenium bcp | | EUR | | | 48 003,53 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 75 735,14 |
| 9 | Outros valores a regularizar | | | | | -5 596,11 |
| | TOTAL DE APLICAÇÕES | | | | | 1 647 152,81 |
| | TOTAL DO FUNDO | | | | | 1 641 556,70 |

Lisboa, 31 de Agosto de 2018