

**FUNDO DE PENSÕES PPR - SGF GARANTIDO**

Valor Patrimonial Unitário em 31/08/2018 6,73649 EUR  
N.º Unidades de Participação em circulação 628 720

<b>1</b>	<b>Valores mobiliários cotados</b>						
<b>11</b>	<b>Mercado cot. ofic. de B.V. Port.</b>						
<b>114</b>	<b>Acções</b>						
	BES	247038	EUR				0
<b>12</b>	<b>Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE</b>						
<b>121</b>	<b>Títulos de dívida pública</b>						
	UK TSY 1,75% 22/07/2019	36 200,00	GBP	100,90	90,33	77,54	40 877,67
	<b>SUB-TOTAL</b>						<b>40 877,67</b>
<b>122</b>	<b>Outros fundos públicos e equiparados</b>						
	EIB 0% 27/08/2021	230 000,00	BRL	78,33	368,49		38 292,64
	EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	860 000,00	NOK	99,87	971,48	294,29	88 585,59
	<b>SUB-TOTAL</b>						<b>126 878,23</b>
<b>123</b>	<b>Obrigações diversas</b>						
	ESF 6.875% 10/2019	100 000,00	EUR	0,11	0,11		111,00
	OREY Best Of 2027 (ex-2018, ex-2021)	30 000,00	EUR	100,00	100,00	66,58	30 066,58
	<b>SUB-TOTAL</b>						<b>30 177,58</b>
<b>3</b>	<b>U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo</b>						
<b>31</b>	<b>Fundos harmonizados</b>						
	AXA Global Inflation Short Duration	2 143,50	EUR	99,37	99,37		212 999,79
	BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 030,62	EUR	165,74	165,74		336 555,62
	Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	494,35	EUR	136,62	136,62		67 538,10
	Bluebay GLB SOV OPP-M EUR	400,52	EUR	104,58	104,58		41 886,49
	CANDRIAM Euro High Yield	65,52	EUR	1 204,31	1 204,31		78 901,57
	Candriam Long Short Global Credit	801,85	EUR	102,78	102,78		82 414,55
	Central Fund Canada LTD	2 699,00	USD	11,75	13,63		27 336,82
	FUNDSMITH Equity Fund	655,35	EUR	35,53	35,53		23 284,59
	GROUPAMA Trésorerie IC	3,34	EUR	40 294,38	40 294,38		134 446,23
	H2O MODERATO-IC	1,00	EUR	80 746,66	80 746,66		80 795,11
	HENDERSON Horizon Pan-European Alpha	4 942,18	EUR	16,70	16,70		82 534,46
	INRIS UCITS R Parus I EUR HD	580,41	EUR	106,68	106,68		61 917,82
	INVESCO Pan European Structured Equity	3 209,54	EUR	14,02	14,02		44 997,75
	ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	439,00	EUR	49,55	49,55		21 752,45
	JP MORGAN Global Corporate Bond	673,96	EUR	95,91	95,91		64 639,02
	JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	7 169,13	EUR	12,67	12,67		90 832,88
	Jupiter Dynamic Bond Fund	15 183,00	EUR	10,61	10,61		161 091,63
	KEMPEN Euro Credit	108,94	EUR	1 402,17	1 402,17		152 752,40
	L&G Emerging Markets Short Duration	43 818,04	EUR	0,96	0,96		42 100,37
	Lyxor BTP 10Y	337,00	EUR	124,82	124,82		42 064,34
	Lyxor Bund 1X Inverse	1 842,00	EUR	46,95	46,95		86 487,43
	M&G Optimal Income Fd C-H	12 244,12	EUR	21,06	21,06		257 820,70
	MAN GLG European Inc Opportunities	429,92	EUR	100,01	100,01		42 996,60
	ML AQR Global Relative Value	643,24	EUR	106,87	106,87		68 742,95
	Merrill Lynch Inv.Sol.-Marshall Wace TOPS	535,50	EUR	145,88	145,88		78 119,32
	NATIXIS TRESORERIE - IC	11,32	EUR	12 513,37	12 513,37		141 651,35
	PIMCO FD-LD GLB IGR C- IEURHA	20 626,12	EUR	10,45	10,45		215 542,94
	PIMCO GIS-INCOME FD (INST)	17 543,47	EUR	13,39	13,39		234 907,10
	VECTOR FUND - NAVIGATOR -I1	20,06	EUR	1 755,64	1 755,64		35 214,63
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 420,23	EUR	106,75	106,75		151 609,66
	Winton Diversified Fund UC- EUR	381,94	EUR	105,90	105,90		40 446,02

<b>SUB-TOTAL</b>						<b>3 204 380,69</b>
<b>4</b>	<b>Imobiliário</b>					
<b>42</b>	<b>U. P.'s de fundos de investimento imobiliário</b>					
	CA Património Crescente	13 320,00	EUR	16,36	16,36	217 852,60
	IMOSOCIAL	20 816,00	EUR	3,20	3,20	66 600,79
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	1 786,00	EUR	15,31	15,31	27 343,66
	SEB Immoinvest	1 022,00	EUR	5,09	5,09	5 199,94
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>316 996,99</b>
<b>5</b>	<b>Liquidez</b>					
<b>51</b>	<b>À vista</b>					
<b>512</b>	<b>Depósitos à ordem</b>					
	BBVA - €		EUR			4 628,37
	CGD-EUR		EUR			131 019,43
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			106,98
	Millenium bcp		EUR			388 341,41
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>524 096,19</b>
<b>52</b>	<b>A prazo</b>					
<b>521</b>	<b>Depósitos e outros equiparados</b>					
<b>9</b>	<b>Outros valores a regularizar</b>		EUR			<b>-8 041,70</b>
	<b>TOTAL DE APLICAÇÕES</b>					<b>4 243 407,35</b>
	<b>TOTAL DO FUNDO</b>					<b>4 235 365,65</b>

Lisboa, 31 de Agosto de 2018