

**FUNDO DE PENSÕES PPR - PATRIMÓNIO REFORMA PRUDENTE**

Valor Patrimonial Unitário em 31/08/2019 1,42711 EUR  
N.º Unidades de Participação em circulação 3 992 329

	Quantidade	Moeda	Cot. Moeda	Cot. Euro	Jur Dec	Valor (Euro)
<b>1 Valores mobiliários cotados</b>						
<b>11 Mercado cot. ofic. de B.V. Port.</b>						
<b>114 Acções</b>						
BES	245 999,00	EUR				0,00
<b>12 Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE</b>						
<b>121 Títulos de dívida pública</b>						
EIB FLOAT 01/10/2022 GBP	50 000,00	GBP	100,28	90,60	78,01	55 580,19
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>55 580,19</b>
<b>122 Outros fundos públicos e equiparados</b>						
EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	1 050 000,00	NOK	99,81	1 001,10	347,52	104 833,62
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>104 833,62</b>
<b>123 Obrigações diversas</b>						
ESF 6.875% 10/2019	100 000,00	EUR	0,13	0,13		125,00
OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	75 000,00	EUR	54,84	54,84		41 130,00
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>41 255,00</b>
<b>124 Acções</b>						
ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	4 580,00	EUR	7,86	7,86		35 998,80
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>35 998,80</b>
<b>3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo</b>						
<b>31 Fundos harmonizados</b>						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 423,74	EUR	187,01	187,01		453 263,43
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	554,28	EUR	141,42	141,42		78 386,28
Bluebay GLB SOV OPP-M EUR	405,18	EUR	98,62	98,62		39 958,65
CANDRIAM Euro High Yield	120,59	EUR	1 282,59	1 282,59		154 661,12
Central Fund Canada LTD	7 551,00	USD	14,95	16,43		102 693,71
ETFS AGRICULTURE	6 622,00	EUR	3,38	3,38		22 385,67
ETFS Copper	1 270,00	EUR	21,48	21,48		27 279,60
FISHER EMERGING MARKETS EQ-EUR						
UH	481,21	EUR	125,22	125,22		60 257,12
FUNDSMITH Equity Fund	4 265,87	EUR	41,19	41,19		175 724,84
First Trust Eurozone ALPHADX	824,00	EUR	30,38	30,38		25 033,94
GROUPAMA Trésorerie IC	2,90	EUR	40 222,37	40 222,37		116 809,78
HENDERSON Horizon Pan-European Alpha	5 284,60	EUR	16,08	16,08		84 976,34
INRIS UCITS R Parus I EUR HD	681,24	EUR	103,96	103,96		70 821,19
INVESCO Pan European Structured Equity	5 027,95	EUR	13,85	13,85		69 637,11
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	876,00	EUR	43,95	43,95		38 495,82
Ishares MSCI Emerging Markets USD	1 427,00	EUR	28,60	28,60		40 805,07
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	8 341,92	EUR	13,72	13,72		114 451,14
Jupiter Dynamic Bond Fund	18 110,98	EUR	11,05	11,05		200 126,33
KEMPEN Euro Credit	147,34	EUR	1 504,84	1 504,84		221 723,13
L&G Emerging Markets Short Duration	117 994,20	EUR	1,02	1,02		120 424,88
La Française Euro Inflation	144,02	EUR	1 805,96	1 805,96		260 087,68
Lindsell Train - GL-Equity EUR	139 175,91	EUR	1,37	1,37		191 255,53
Lyxor Bund 1X Inverse	7 647,00	EUR	41,91	41,91		320 447,54
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	30 582,52	EUR	10,32	10,32		315 608,59
MAN GLG European Inc Opportunities	721,86	EUR	96,84	96,84		69 904,83
MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I	30,66	EUR	1 137,90	1 137,90		34 891,58
Merrill Lynch Inv.Sol.-Marshall Wace TOPS	674,44	EUR	138,58	138,58		93 464,17

	NATIXIS TRESORERIE - IC	7,95	EUR	12 479,87	12 479,87	99 214,97
	ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	715,47	EUR	31,63	31,63	22 630,16
	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	1 682,00	USD	18,64	20,49	28 521,35
	PIMCO GIS-INCOME FD (INST)	20 819,06	EUR	13,87	13,87	288 760,35
	Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	19 000,64	EUR	2,34	2,34	44 461,50
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	1 852,00	USD	15,35	16,87	25 861,13
	US NATURAL GAS FUND LP	1 324,00	USD	19,77	21,73	23 811,83
	VECTOR FUND - NAVIGATOR -I1	97,70	EUR	1 744,95	1 744,95	170 472,89
	Vaneck Vectors Gold Miners	1 639,00	USD	29,86	32,82	44 521,21
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	2 223,94	EUR	108,57	108,57	241 453,38
	Winton Diversified Fund UC- EUR	830,72	EUR	107,63	107,63	89 409,89
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>4 582 693,73</b>
<b>32</b>	<b>Fundos não harmonizados</b>					
	BANIF Global Private Equity Fund - FCR	232 666,72	EUR	0,19	0,19	43 455,16
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>43 455,16</b>
<b>4</b>	<b>Imobiliário</b>					
<b>42</b>	<b>U. P.'s de fundos de investimento imobiliário</b>					
	CA Património Crescente	14 808,00	EUR	17,26	17,26	255 535,73
	SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN	2 400,00	EUR	9,12	9,12	21 888,00
	SEB Immoinvest	8 105,00	EUR	4,59	4,59	37 161,43
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>314 585,16</b>
<b>5</b>	<b>Liquidez</b>					
<b>51</b>	<b>À vista</b>					
<b>512</b>	<b>Depósitos à ordem</b>					
	BBVA - EUR		EUR			22 342,17
	BBVA-USD		USD			24,43
	CGD-EUR		EUR			99 060,75
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			100,69
	Millenium USD		USD			0,01
	Millenium bcp		EUR			390 427,74
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>511 955,79</b>
<b>52</b>	<b>A prazo</b>					
<b>521</b>	<b>Depósitos e outros equiparados</b>					
	Millenium GBP	400 000,00	GBP			-0,01
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>-0,01</b>
<b>9</b>	<b>Outros valores a regularizar</b>					<b>7 150,22</b>
	<b>TOTAL DE APLICAÇÕES</b>					<b>5 690 357,44</b>
	<b>TOTAL DO FUNDO</b>					<b>5 697 507,66</b>

Lisboa, 31 de Agosto de 2019