

Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Ativa

Valor Patrimonial Unitário em 31/12/2019 5,35412
N.º Unidades de Participação em circulação 382362

| | 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 | 160 956,00 | EUR | | | | 0,00 |
| 12 Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE | | | | | | |
| 122 Outros fundos públicos e equiparados | | | | | | |
| EIB 0% 27/08/2021 BRL | 150 000,00 | BRL | 92,94 | 418,45 | | 30 962,29 |
| EIB 1,125% 15/05/2020 NOK | 250 000,00 | NOK | 99,77 | 984,86 | 179,04 | 25 444,78 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 56 407,07 |
| 123 Obrigações diversas | | | | | | |
| OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021) | 30 000,00 | EUR | 5,00 | 5,00 | | 1 500,00 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 1 500,00 |
| 124 Acções | | | | | | |
| ISHARES Eurostoxx Banks 30-15 | 5 082,00 | EUR | 9,48 | 9,48 | | 48 177,36 |
| SPDR Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF | 1 128,00 | EUR | 41,01 | 41,01 | | 46 253,64 |
| iShares MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF | 7 321,00 | EUR | 5,84 | 5,84 | | 42 726,09 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 137 157,09 |
| 3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo | | | | | | |
| 31 Fundos harmonizados | | | | | | |
| BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov. | 331,29 | EUR | 182,09 | 182,09 | | 60 324,96 |
| CANDRIAM Euro High Yield | 47,02 | EUR | 1 302,36 | 1 302,36 | | 61 236,97 |
| Central Fund Canada LTD | 2 996,00 | USD | 14,66 | 16,42 | | 39 212,99 |
| ETFS AGRICULTURE | 6 969,00 | EUR | 3,66 | 3,66 | | 25 537,90 |
| ETFS Copper | 1 240,00 | EUR | 23,19 | 23,19 | | 28 755,60 |
| FUNDSMITH Equity Fund | 3 561,82 | EUR | 42,63 | 42,63 | | 151 843,24 |
| ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED | 790,00 | EUR | 49,78 | 49,78 | | 39 326,20 |
| Ishares MSCI Emerging Markets USD | 2 602,00 | EUR | 32,02 | 32,02 | | 83 316,04 |
| JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY | 6 684,17 | EUR | 13,52 | 13,52 | | 90 369,98 |
| L&G Emerging Markets Short Duration | 58 839,20 | EUR | 1,04 | 1,04 | | 61 098,62 |
| Lindsell Train - GL-Equity EUR | 110 135,40 | EUR | 1,37 | 1,37 | | 150 433,94 |
| Lyxor Bund 1X Inverse | 1 211,00 | EUR | 43,67 | 43,67 | | 52 878,32 |
| M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC | 8 791,89 | EUR | 10,56 | 10,56 | | 92 853,82 |
| MAN GLG European Inc Opportunities | 852,36 | EUR | 110,41 | 110,41 | | 94 108,63 |
| MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I | 60,29 | EUR | 1 137,43 | 1 137,43 | | 68 571,72 |
| Man GLG Innovation Equity Alternative IN H EUR Acc | 255,13 | EUR | 107,23 | 107,23 | | 27 357,16 |
| ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR | 1 073,20 | EUR | 36,33 | 36,33 | | 38 989,27 |
| PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD | 1 112,00 | USD | 19,16 | 21,46 | | 19 021,93 |
| Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund | 17 987,81 | EUR | 2,43 | 2,43 | | 43 685,20 |
| THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS | 2 266,00 | USD | 16,30 | 18,26 | | 32 976,28 |
| US NATURAL GAS FUND LP | 1 229,00 | USD | 16,86 | 18,88 | | 18 499,66 |
| VECTOR FUND - NAVIGATOR -II | 76,14 | EUR | 1 850,28 | 1 850,28 | | 140 871,07 |
| VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I) | 312,55 | EUR | 127,75 | 127,75 | | 39 928,39 |
| Vaneck Vectors Gold Miners | 2 054,00 | USD | 29,28 | 32,80 | | 53 693,99 |
| Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund | 352,77 | EUR | 109,02 | 109,02 | | 38 458,55 |
| Winton Diversified Fund UC- EUR | 286,46 | EUR | 102,97 | 102,97 | | 29 495,80 |
| iShares \$ TreasuryBond 1-3yr UCITS ETF USD (Acc) B | 487,00 | USD | 111,24 | 124,60 | | 48 366,44 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 1 631 212,67 |



| | | | | | | |
|---|-----------|-----|-------|-------|---------------------|--|
| 32 Fundos não harmonizados | | | | | | |
| BANIF Global Private Equity Fund - FCR | 83 333,33 | EUR | 0,19 | 0,19 | 15 564,17 | |
| SUB-TOTAL | | | | | 15 564,17 | |
| 4 Imobiliário | | | | | | |
| 42 U. P.'s de fundos de investimento imobiliário | | | | | | |
| CA Património Crescente | 2 694,00 | EUR | 17,62 | 17,62 | 47 460,47 | |
| SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN | 500,00 | EUR | 9,19 | 9,19 | 4 595,00 | |
| SEB Immoinvest | 934,00 | EUR | 2,05 | 2,05 | 1 917,50 | |
| SUB-TOTAL | | | | | 53 972,97 | |
| 5 Liquidez | | | | | | |
| 51 À vista | | | | | | |
| 512 Depósitos à ordem | | | | | | |
| CGD-EUR | | EUR | | | 71 726,42 | |
| Cx. Crédito Agrícola Mútuo | | EUR | | | 365,34 | |
| Millenium bcp | | EUR | | | 81 102,85 | |
| SUB-TOTAL | | | | | 153 194,61 | |
| 52 A prazo | | | | | | |
| 521 Depósitos e outros equiparados | | | | | | |
| 9 Outros valores a regularizar | | EUR | | | -5 130,39 | |
| TOTAL DE APLICAÇÕES | | | | | 2 049 008,58 | |
| TOTAL DO FUNDO | | | | | 2 043 878,19 | |

Lisboa, 31 de Dezembro de 2019