

Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Equilibrada

Valor Patrimonial Unitário em 31/12/2019 6,27986 EUR
N.º Unidades de Participação em circulação 726387

	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	269 682,00	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	340 000,00	BRL	92,94	418,45		70 181,20
EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	600 000,00	NOK	99,77	984,86	429,69	61 067,46
EIB 1,50% 12/05/2022 NOK	290 000,00	NOK	99,65	983,68	281,02	29 554,32
SUB-TOTAL						160 802,98
123 Obrigações diversas						
OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	60 000,00	EUR	5,00	5,00		3 000,00
SUB-TOTAL						3 000,00
124 Acções						
ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	7 603,00	EUR	9,48	9,48		72 076,44
SPDR Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	1 704,00	EUR	41,01	41,01		69 872,52
iShares MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF	8 036,00	EUR	5,84	5,84		46 898,90
SUB-TOTAL						188 847,86
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	1 850,48	EUR	182,09	182,09		336 953,54
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	247,19	EUR	138,98	138,98		34 354,47
CANDRIAM Euro High Yield	84,54	EUR	1 302,36	1 302,36		110 101,51
Central Fund Canada LTD	7 719,00	USD	14,66	16,42		101 029,73
ETFS AGRICULTURE	11 237,00	EUR	3,66	3,66		41 177,99
ETFS Copper	1 855,00	EUR	23,19	23,19		43 017,45
FUNDSMITH Equity Fund	4 413,71	EUR	42,63	42,63		188 159,99
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	1 236,00	EUR	49,78	49,78		61 528,08
Ishares MSCI Emerging Markets USD	2 446,00	EUR	32,02	32,02		78 320,92
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	11 510,03	EUR	13,52	13,52		155 615,61
Jupiter Dynamic Bond Fund	8 336,00	EUR	10,70	10,70		89 195,20
KEMPEN Euro Credit	60,55	EUR	1 485,87	1 485,87		89 969,43
L&G Emerging Markets Short Duration	108 909,36	EUR	1,04	1,04		113 091,47
La Française Euro Inflation	88,18	EUR	1 753,64	1 753,64		154 633,17
Lindsell Train - GL-Equity EUR	135 547,73	EUR	1,37	1,37		185 144,64
Lyxor Bund IX Inverse	6 386,00	EUR	43,67	43,67		278 844,69
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	24 062,03	EUR	10,56	10,56		254 126,36
MAN GLG European Inc Opportunities	1 060,75	EUR	110,41	110,41		117 117,30
MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I	79,48	EUR	1 137,43	1 137,43		90 400,00
Man GLG Innovation Equity Alternative IN H EUR Acc	746,48	EUR	107,23	107,23		80 045,05
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	1 369,43	EUR	36,33	36,33		49 751,48
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	2 457,00	USD	19,16	21,46		42 029,56
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	3 237,00	EUR	30,01	30,01		97 129,42
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	29 280,20	EUR	2,43	2,43		71 109,89
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	5 473,00	USD	16,30	18,26		79 646,60
US NATURAL GAS FUND LP	2 314,00	USD	16,86	18,88		34 831,73
VECTOR FUND - NAVIGATOR -II	108,33	EUR	1 850,28	1 850,28		200 442,68



	VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	551,08	EUR	127,75	127,75	70 400,09
	Vaneck Vectors Gold Miners	1 820,00	USD	29,28	32,80	47 576,95
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 452,80	EUR	109,02	109,02	158 384,69
	Winton Diversified Fund UC- EUR	641,25	EUR	102,97	102,97	66 028,54
	iShares \$ TreasuryBond 1-3yr UCITS ETF USD (Acc) B	1 364,00	USD	111,24	124,60	135 465,76
	SUB-TOTAL					3 655 623,99
32	Fundos não harmonizados					
	BANIF Global Private Equity Fund - FCR	178 333,32	EUR	0,19	0,19	33 307,31
	SUB-TOTAL					33 307,31
4	Imobiliário					
42	U. P.'s de fundos de investimento imobiliário					
	CA Património Crescente	7 437,00	EUR	17,62	17,62	131 018,37
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	1 500,00	EUR	9,19	9,19	13 785,00
	SEB Immoinvest	3 410,00	EUR	2,05	2,05	7 000,73
	SUB-TOTAL					151 804,10
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			14 651,97
	CGD-EUR		EUR			73 370,46
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			46,87
	Millenium bcp		EUR			281 880,18
	SUB-TOTAL					369 949,48
52	A prazo					
521	Depósitos e outros equiparados					
9	Outros valores a regularizar		EUR			-1 728,01
	TOTAL DE APLICAÇÕES					4 563 335,72
	TOTAL DO FUNDO					4 561 607,71

Lisboa, 31 de Dezembro de 2019