

## Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Garantida

Valor Patrimonial Unitário em 31/12/2019 6.735 EUR  
 N.º Unidades de Participação em circulação 1103044

	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	247038	EUR				0
<b>12 Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE</b>						
<b>122 Outros fundos públicos e equiparados</b>						
EIB 0% 27/08/2021 BRL	335 000,00	BRL	92,94	418,45		69 149,12
EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	1 060 000,00	NOK	99,77	984,86	759,13	107 885,87
EIB 1,50% 12/05/2022 NOK	190 000,00	NOK	99,65	983,68	184,11	19 363,17
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>196 398,16</b>
<b>123 Obrigações diversas</b>						
ESF 6,875% 10/2019	100 000,00	EUR	0,01	0,01		10,00
OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	30 000,00	EUR	5,00	5,00		1 500,00
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>1 510,00</b>
<b>124 Acções</b>						
ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	3 862,00	EUR	9,48	9,48		36 611,76
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>36 611,76</b>
<b>3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo</b>						
<b>31 Fundos harmonizados</b>						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 917,76	EUR	182,09	182,09		531 294,19
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	614,68	EUR	138,98	138,98		85 428,23
Bluebay GLB SOV OPP-M EUR	1 214,65	EUR	101,98	101,98		123 870,11
CANDRIAM Euro High Yield	183,56	EUR	1 302,36	1 302,36		239 058,60
Candriam Long Short Global Credit	801,85	EUR	103,74	103,74		83 184,33
Central Fund Canada LTD	3 742,00	USD	14,66	16,42		48 976,97
FUNDSMITH Equity Fund	1 594,79	EUR	42,63	42,63		67 987,17
GROUPAMA Trésorerie IC	3,34	EUR	40 179,73	40 179,73		134 063,69
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	724,00	EUR	49,78	49,78		36 040,72
Ishares MSCI Emerging Markets USD	1 000,00	EUR	32,02	32,02		32 020,00
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	15 167,29	EUR	13,52	13,52		205 061,76
Jupiter Dynamic Bond Fund	15 183,00	EUR	10,70	10,70		162 458,10
KEMPEN Euro Credit	226,73	EUR	1 485,87	1 485,87		336 891,31
L&G Emerging Markets Short Duration	196 971,27	EUR	1,04	1,04		204 534,97
LYXOR ETF EuroMTS 1-3 Y	3 200,00	EUR	124,97	124,97		399 911,36
La Française Euro Inflation	190,73	EUR	1 753,64	1 753,64		334 475,44
Lindsell Train - GL-Equity EUR	51 387,67	EUR	1,37	1,37		70 190,41
Lyxor Bund 1X Inverse	9 238,00	EUR	43,67	43,67		403 377,27
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	32 419,80	EUR	10,56	10,56		342 395,18
MAN GLG European Inc Opportunities	1 261,06	EUR	110,41	110,41		139 233,41
Man GLG Innovation Equity Alternative IN H EUR						
Acc	1 067,75	EUR	107,23	107,23		114 494,83
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	4 293,00	EUR	30,01	30,01		128 815,76
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	4 333,00	USD	16,30	18,26		63 056,59
VECTOR FUND - NAVIGATOR -II	36,73	EUR	1 850,28	1 850,28		67 951,53
VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	271,43	EUR	127,75	127,75		34 674,67
Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	3 721,00	EUR	109,02	109,02		405 663,86
Winton Diversified Fund UC- EUR	900,57	EUR	102,97	102,97		92 729,79
iShares \$ TreasuryBond 1-3yr UCITS ETF USD (Acc) B	3 205,00	USD	111,24	124,60		318 304,81
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>5 206 145,06</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	17,62	17,62		234 659,77
	SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN	1 786,00	EUR	9,19	9,19		16 413,34
	SEB Immoinvest	1 022,00	EUR	2,05	2,05		2 098,17
	<b>SUB-TOTAL</b>						<b>253 171,28</b>
<b>5</b>	<b>Liquidez</b>						
<b>51</b>	<b>À vista</b>						
<b>512</b>	<b>Depósitos à ordem</b>						
	BBVA - €		EUR				341,49
	CGD-EUR		EUR				1 095 543,73
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR				106,98
	Millenium bcp		EUR				650 767,39
	<b>SUB-TOTAL</b>						<b>1 746 759,59</b>
<b>9</b>	<b>Outros valores a regularizar</b>	215 000,00	EUR				<b>-11 590,27</b>
	<b>TOTAL DE APLICAÇÕES</b>						<b>7 440 595,85</b>
	<b>TOTAL DO FUNDO</b>						<b>7 429 005,58</b>

Lisboa, 31 de Dezembro de 2019