



## Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Garantida

Valor Patrimonial Unitário em 30/11/2019 6,72712 EUR  
 N.º Unidades de Participação em circulação 1046278

|   | 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 1,125% 15/05/2020 NOK                                     | 1 060 000,00 | NOK   | 99,75      | 1 013,72  | 638,01  | 104 681,25          |
| EIB 1,50% 12/05/2022 NOK                                      | 190 000,00   | NOK   | 99,65      | 1 012,70  | 155,05  | 18 785,61           |
| <b>SUB-TOTAL</b>  |              |       |            |           |         | <b>123 466,86</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   | 9,13       | 9,13      |         | 35 260,06           |
| <b>SUB-TOTAL</b>  |              |       |            |           |         | <b>35 260,06</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   | 183,40     | 183,40    |         | 535 116,45          |
| Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return                      | 614,68       | EUR   | 140,16     | 140,16    |         | 86 153,55           |
| Bluebay GLB SOV OPP-M EUR                                     | 1 214,65     | EUR   | 100,12     | 100,12    |         | 121 610,86          |
| CANDRIAM Euro High Yield                                      | 183,56       | EUR   | 1 290,70   | 1 290,70  |         | 236 918,31          |
| Candriam Long Short Global Credit                             | 801,85       | EUR   | 103,56     | 103,56    |         | 83 040,00           |
| Central Fund Canada LTD                                       | 3 742,00     | USD   | 14,07      | 15,50     |         | 47 779,82           |
| FUNDSMITH Equity Fund   | 1 594,79     | EUR   | 42,37      | 42,37     |         | 67 578,91           |
| GROUPAMA Trésorerie IC  | 3,34         | EUR   | 40 189,32  | 40 189,32 |         | 134 095,69          |
| ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED                                   | 724,00       | EUR   | 49,98      | 49,98     |         | 36 181,90           |
| Ishares MSCI Emerging Markets USD                             | 1 000,00     | EUR   | 30,29      | 30,29     |         | 30 290,00           |
| JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY                               | 15 167,29    | EUR   | 13,62      | 13,62     |         | 206 578,49          |
| Jupiter Dynamic Bond Fund                                     | 15 183,00    | EUR   | 10,88      | 10,88     |         | 165 191,04          |
| KEMPEN Euro Credit  | 226,73       | EUR   | 1 487,78   | 1 487,78  |         | 337 324,36          |
| L&G Emerging Markets Short Duration                           | 196 971,27   | EUR   | 1,03       | 1,03      |         | 202 033,43          |
| LYXOR ETF EuroMTS 1-3 Y                                       | 3 200,00     | EUR   | 125,02     | 125,02    |         | 400 079,36          |
| La Française Euro Inflation                                   | 190,73       | EUR   | 1 759,11   | 1 759,11  |         | 335 518,74          |
| Lindsell Train - GL-Equity EUR                                | 51 387,67    | EUR   | 1,36       | 1,36      |         | 70 077,36           |
| Lyxor Bund 1X Inverse   | 9 238,00     | EUR   | 43,08      | 43,08     |         | 397 926,85          |
| M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC                                  | 32 419,80    | EUR   | 10,46      | 10,46     |         | 339 273,15          |
| MAN GLG European Inc Opportunities                            | 1 261,06     | EUR   | 108,91     | 108,91    |         | 137 341,83          |
| Man GLG Innovation Equity Alternative IN H EUR Acc            | 1 067,75     | EUR   | 105,46     | 105,46    |         | 112 604,92          |
| SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF                        | 4 293,00     | EUR   | 29,52      | 29,52     |         | 126 729,36          |
| THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS                                | 4 333,00     | USD   | 15,98      | 17,61     |         | 62 816,86           |
| VECTOR FUND - NAVIGATOR -II                                   | 20,84        | EUR   | 1 848,12   | 1 848,12  |         | 38 505,58           |
| VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)                             | 271,43       | EUR   | 122,53     | 122,53    |         | 33 257,83           |
| Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund               | 3 721,00     | EUR   | 108,79     | 108,79    |         | 404 808,03          |
| Winton Diversified Fund UC- EUR                               | 900,57       | EUR   | 102,54     | 102,54    |         | 92 347,95           |
| iShares \$ TreasuryBond 1-3yr UCITS ETF USD (Acc) B           | 3 205,00     | USD   | 110,86     | 122,16    |         | 322 440,47          |
| <b>SUB-TOTAL</b>  |              |       |            |           |         | <b>5 163 621,10</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 | 17,55 | 17,55 | 233 805,96          |
|            | SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN                      | 1 786,00   | EUR | 9,07  | 9,07  | 16 199,02           |
|            | SEB Immoinvest                                       | 1 022,00   | EUR | 4,23  | 4,23  | 4 323,06            |
|            | <b>SUB-TOTAL</b>                                     |            |     |       |       | <b>254 328,04</b>   |
| <b>5</b>   | <b>Liquidez</b>                                      |            |     |       |       |                     |
| <b>51</b>  | <b>À vista</b>                                       |            |     |       |       |                     |
| <b>512</b> | <b>Depósitos à ordem</b>                             |            |     |       |       |                     |
|            | BBVA - €   |            | EUR |       |       | 671,49              |
|            | CGD-EUR  |            | EUR |       |       | 1 010 360,77        |
|            | Cx. Crédito Agrícola Mútuo                           |            | EUR |       |       | 106,98              |
|            | Millenium bcp  |            | EUR |       |       | 427 997,67          |
|            | <b>SUB-TOTAL</b>                                     |            |     |       |       | <b>1 439 136,91</b> |
| <b>9</b>   | <b>Outros valores a regularizar</b>                  | 215 000,00 | EUR |       |       | <b>21 114,84</b>    |
|            | <b>TOTAL DE APLICAÇÕES</b>                           |            |     |       |       | <b>7 017 322,97</b> |
|            | <b>TOTAL DO FUNDO</b>                                |            |     |       |       | <b>7 038 437,81</b> |

Lisboa, 30 de Novembro de 2019