

Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Ativa

Valor Patrimonial Unitário em 31/01/2020 5,32191
N.º Unidades de Participação em circulação 410837,3018

	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	441,51		29 345,17
EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	250 000,00	NOK	99,82	1 019,62	196,35	24 627,54
SUB-TOTAL						53 972,71
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	8,89	8,89		45 194,23
SPDR Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	1 250,00	EUR	40,06	40,06		50 068,75
iShares MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF	7 321,00	EUR	5,76	5,76		42 168,96
SUB-TOTAL						137 431,94
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	331,29	EUR	185,44	185,44		61 434,79
CANDRIAM Euro High Yield	47,02	EUR	1 299,77	1 299,77		61 115,19
Central Fund Canada LTD	2 996,00	USD	15,42	17,11		41 638,55
ETFS AGRICULTURE	6 969,00	EUR	3,52	3,52		24 523,91
ETFS Copper	1 240,00	EUR	21,03	21,03		26 071,00
FUNDSMITH Equity Fund	3 561,82	EUR	44,12	44,12		157 140,73
ISHARES EURO INFL GOVT	141,00	EUR	223,55	223,55		31 520,55
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	790,00	EUR	48,64	48,64		38 425,60
Ishares MSCI Emerging Markets USD	2 602,00	EUR	30,60	30,60		79 608,19
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	6 830,69	EUR	13,83	13,83		94 468,44
L&G Emerging Markets Short Duration	58 849,80	EUR	1,05	1,05		61 615,74
Lindsell Train - GL-Equity EUR	110 135,40	EUR	1,38	1,38		151 876,72
Lyxor Bund 1X Inverse	2 108,00	EUR	42,50	42,50		89 590,00
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	8 791,89	EUR	10,52	10,52		92 505,66
MAN GLG European Inc Opportunities	852,36	EUR	108,89	108,89		92 813,04
MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I	60,29	EUR	1 026,72	1 026,72		61 897,18
Man GLG Innovation Equity Alternative IN H EUR Acc	255,13	EUR	108,73	108,73		27 739,85
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	1 073,20	EUR	34,89	34,89		37 443,86
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	1 112,00	USD	19,38	21,50		19 423,52
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	17 987,81	EUR	2,45	2,45		44 154,68
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	2 266,00	USD	17,05	18,92		34 822,00
US NATURAL GAS FUND LP	1 229,00	USD	14,37	15,94		15 917,62
VECTOR FUND - NAVIGATOR -II	76,14	EUR	1 878,55	1 878,55		143 023,40
VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	312,55	EUR	128,34	128,34		40 112,80
Vaneck Vectors Gold Miners	2 054,00	USD	28,99	32,16		53 668,32
Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	380,20	EUR	109,41	109,41		41 597,13
Winton Diversified Fund UC- EUR	286,46	EUR	103,83	103,83		29 743,30
SUB-TOTAL						1 653 891,77



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	17,69	17,69		47 663,60
SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN	500,00	EUR	9,17	9,17		4 585,00
SEB Immoinvest	934,00	EUR	2,24	2,24		2 094,96
SUB-TOTAL						54 343,56
5 Liquidez						
51 À vista						
512 Depósitos à ordem						
CGD-EUR		EUR				225 070,13
Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR				365,34
Millenium bcp		EUR				49 642,71
SUB-TOTAL						275 078,18
9 Outros valores a regularizar		EUR				-5 341,96
TOTAL DE APLICAÇÕES						2 191 782,33
TOTAL DO FUNDO						2 186 440,37

Lisboa, 31 de Janeiro de 2020