

Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Equilibrada

Valor Patrimonial Unitário em 31/01/2020 6,26529 EUR

N.º Unidades de Participação em circulação 731900,207

	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	441,51		66 515,73
EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	600 000,00	NOK	99,82	1 019,62	471,24	59 106,10
EIB 1,50% 12/05/2022 NOK	290 000,00	NOK	100,21	1 023,60	307,72	28 758,34
SUB-TOTAL						154 380,17
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	8,89	8,89		67 613,48
SPDR Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	1 704,00	EUR	40,06	40,06		68 253,72
iShares MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF	8 036,00	EUR	5,76	5,76		46 287,36
SUB-TOTAL						182 154,56
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	1 850,48	EUR	185,44	185,44		343 152,64
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	247,19	EUR	142,23	142,23		35 157,83
CANDRIAM Euro High Yield	90,67	EUR	1 299,77	1 299,77		117 846,25
Central Fund Canada LTD	7 719,00	USD	15,42	17,11		107 279,02
ETFS AGRICULTURE	11 237,00	EUR	3,52	3,52		39 543,00
ETFS Copper	1 855,00	EUR	21,03	21,03		39 001,38
FUNDSMITH Equity Fund	4 413,71	EUR	44,12	44,12		194 724,50
ISHARES EURO INFL GOVT	322,00	EUR	223,55	223,55		71 983,10
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	1 236,00	EUR	48,64	48,64		60 119,04
Ishares MSCI Emerging Markets USD	2 446,00	EUR	30,60	30,60		74 835,37
JUPITER JGF - Dynamic Bond - DY	12 535,67	EUR	13,83	13,83		173 368,32
Jupiter Dynamic Bond Fund	8 336,00	EUR	10,95	10,95		91 279,20
KEMPEN Euro Credit	60,55	EUR	1 501,93	1 501,93		90 941,86
L&G Emerging Markets Short Duration	108 928,98	EUR	1,05	1,05		114 048,64
La Française Euro Inflation	88,18	EUR	1 784,88	1 784,88		157 387,86
Lindsell Train - GL-Equity EUR	135 547,73	EUR	1,38	1,38		186 920,32
Lyxor Bund 1X Inverse	8 110,00	EUR	42,50	42,50		344 675,00
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	24 534,60	EUR	10,52	10,52		258 145,71
MAN GLG European Inc Opportunities	1 060,75	EUR	108,89	108,89		115 504,96
MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I	79,48	EUR	1 026,72	1 026,72		81 600,78
Man GLG Innovation Equity Alternative IN H EUR						
Acc	746,48	EUR	108,73	108,73		81 164,77
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	1 369,43	EUR	34,89	34,89		47 779,50
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	2 457,00	USD	19,38	21,50		42 916,90
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	3 237,00	EUR	29,96	29,96		96 993,47
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	29 280,20	EUR	2,45	2,45		71 874,10
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	5 473,00	USD	17,05	18,92		84 104,49
US NATURAL GAS FUND LP	2 314,00	USD	14,37	15,94		29 970,19
VECTOR FUND - NAVIGATOR -II	108,33	EUR	1 878,55	1 878,55		203 505,20
VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	551,08	EUR	128,34	128,34		70 725,22



	Vaneck Vectors Gold Miners	1 820,00	USD	28,99	32,16	47 554,21
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 516,81	EUR	109,41	109,41	165 953,74
	Winton Diversified Fund UC- EUR	641,25	EUR	103,83	103,83	66 582,58
	SUB-TOTAL					3 706 639,15
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	17,69	17,69	131 579,12
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	1 500,00	EUR	9,17	9,17	13 755,00
	SEB Immoinvest	3 410,00	EUR	2,24	2,24	7 648,63
	SUB-TOTAL					152 982,75
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			21 425,15
	CGD-EUR		EUR			108 205,98
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			46,87
	Millenium bcp		EUR			239 516,22
	SUB-TOTAL					369 194,22
9	Outros valores a regularizar		EUR			-16 094,43
	TOTAL DE APLICAÇÕES					4 601 658,16
	TOTAL DO FUNDO					4 585 563,73

Lisboa, 31 de Janeiro de 2020