

Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Ativa

Valor Patrimonial Unitário em 31/03/2020 4,71688
 N.º Unidades de Participação em circulação 472.105,78615

1 Valores mobiliários cotados						
11 Mercado cot. ofic. de B.V. Port.						
114 Acções						
BES	160 956,00	EUR				0,00
Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est.						
12 Membro da UE						
122 Outros fundos públicos e equiparados						
EIB 0% 27/08/2021 BRL	150 000,00	BRL	92,94	533,82		24 270,76
EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	250 000,00	NOK	99,97	1147,76	214,85	21 983,32
SUB-TOTAL						46 254,08
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	5 597,00	EUR	5,30	5,30		29 641,71
SUB-TOTAL						29 641,71
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	331,29	EUR	181,18	181,18		60 023,48
Central Fund Canada LTD	4 011,00	USD	14,62	16,13		53 152,04
ComStage Bund-Future Short UCITS						
ETF	1 940,00	EUR	51,60	51,60		100 100,12
ETF WTI CRUDE OIL (EUR)	4 783,00	EUR	2,76	2,76		13 201,08
ETFS AGRICULTURE	6 969,00	EUR	3,36	3,36		23 408,87
ETFS AGRICULTURE USD	2 519,00	USD	3,70	4,08		8 437,65
ETFS Copper	1 240,00	EUR	18,56	18,56		23 011,92
ETFS Copper USD	324,00	USD	20,42	22,53		5 996,81
FUNDSMITH Equity Fund	3 821,88	EUR	37,73	37,73		144 214,06
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	949,00	EUR	41,41	41,41		39 298,09
Ishares MSCI Emerging Markets USD	2 909,00	EUR	25,13	25,13		73 103,17
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	6 830,69	EUR	13,26	13,26		90 574,95
L&G Emerging Markets Short Duration	58 860,46	EUR	0,89	0,89		52 491,76
Lindsell Train - GL-Equity EUR	122 239,35	EUR	1,17	1,17		142 665,55
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	5 220,89	EUR	9,37	9,37		48 928,12
MAN GLG European Inc Opportunities	959,11	EUR	79,62	79,62		76 364,18
Man GLG Innovation Equity Alternative IN						
H EUR Acc	255,13	EUR	108,41	108,41		27 658,21
ORBIS SICAV - Japan Equity -						
EUR	1 073,20	EUR	29,36	29,36		31 509,08
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	2 237,00	USD	18,18	20,06		36 862,07
Pick US iShares MSCI Global Metals & Mining Producers	3 377,00	USD	19,30	21,29		59 075,62
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	17 987,81	EUR	2,05	2,05		36 867,82
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	2 523,00	USD	13,00	14,34		29 729,01
US NATURAL GAS FUND LP	1 706,00	USD	12,55	13,85		19 406,30
VECTOR FUND - NAVIGATOR -II	92,47	EUR	1 473,29	1 473,29		136 232,18
VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	386,75	EUR	104,04	104,04		40 236,95
Vaneck Vectors Gold Miners	2 054,00	USD	23,04	25,42		42 894,62
Vontobel Fund - TwentyFour Abs.						
Ret.Credit Fund	380,20	EUR	105,51	105,51		40 114,37



Winton Diversified Fund UC- EUR	286,46	EUR	90,54	90,54	25 935,44
WisdomTree Long NOK Short EUR	1 441,00	EUR	35,75	35,75	51 515,75
SUB-TOTAL					1 533 009,27
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	17,82	17,82	48 012,47
SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	500,00	EUR	9,15	9,15	4 575,00
SEB Immoinvest	934,00	EUR	1,84	1,84	1 718,56
SUB-TOTAL					54 306,03
5 Liquidez					
51 À vista					
512 Depósitos à ordem					
CGD-EUR		EUR			141 432,71
Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			365,34
DERIVADOS - Golden Broker		EUR			39 856,66
Golden Conta margem Forward USD		EUR			16 740,00
Millenium bcp		EUR			349 475,10
SUB-TOTAL					547 869,81
7 Operações com produtos derivados					
72 Fora de mercado regulamentado					
721 Forwards					
EUR/USD 22-04-2020 1.0707 BUY	1,00	EUR	4 117,80	4 117,80	4 117,80
SUB-TOTAL					4 117,80
9 Outros valores a regularizar					-5 396,44
TOTAL DE APLICAÇÕES					2 232 262,87
TOTAL DO FUNDO					2 226 866,43

Lisboa, 31 de Março de 2020