

Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Conservadora

		Valor Patrimonial Unitário em 31/03/2020			1,3090 EUR		
		N.º Unidades de Participação em circulação			7102174,7817		
1	Valores mobiliários cotados						
11	Mercado cot. ofic. de B.V. Port.						
114	Acções						
	BES	555 681,00	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	610 000,00	BRL	92,94	533,82		98 701,09
	EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	1 910 000,00	NOK	99,97	1 147,76	1 641,45	167 952,54
	SUB-TOTAL						26653,63
123	Obrigações diversas						
	ESF 6.875% 10/2019	200 000,00	EUR	0,01	0,01		20,00
	OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	175 000,00	EUR	5,00	5,00		8 750,00
	SUB-TOTAL						8 770,00
124	Acções						
	ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	10 991,00	EUR	5,30	5,30		58 208,34
	SUB-TOTAL						58 208,34
3	U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31	Fundos harmonizados						
	BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	4 006,81	EUR	181,18	181,18		725 953,84
	Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	980,86	EUR	145,48	145,48		142 695,51
	Bluebay GLB SOV OPP-M EUR	912,09	EUR	92,42	92,42		84 295,54
	CANDRIAM Euro High Yield	155,03	EUR	1 159,85	1 159,85		179 808,07
	Candriam Long Short Global Credit	473,38	EUR	101,63	101,63		48 110,02
	Central Fund Canada LTD	14 108,00	USD	14,62	16,13		186 953,12
	ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	14 760,00	EUR	51,60	51,60		761 586,48
	ETF WTI CRUDE OIL (EUR)	6 812,00	EUR	2,76	2,76		18 801,12
	ETFS AGRICULTURE	11 803,00	EUR	3,36	3,36		39 646,28
	ETFS AGRICULTURE USD	1 959,00	USD	3,70	4,08		6 561,87
	ETFS Copper	2 121,00	EUR	18,56	18,56		39 361,52
	ETFS Copper USD	185,00	USD	20,42	22,53		3 424,11
	FUNDSMITH Equity Fund	5 943,42	EUR	37,73	37,73		224 267,82
	GROUPAMA Trésorerie IC	2,90	EUR	40 103,45	40 103,45		116 464,43
	ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	1 506,00	EUR	41,41	41,41		62 363,46
	Ishares MSCI Emerging Markets USD	2 379,00	EUR	25,13	25,13		59 784,27
	JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	15 083,46	EUR	13,26	13,26		200 006,68
	Jupiter Dynamic Bond Fund	31 345,56	EUR	10,41	10,41		326 307,28
	KEMPEN Euro Credit	244,51	EUR	1 408,52	1 408,52		344 397,23
	L&G Emerging Markets Short Duration	250 778,42	EUR	0,89	0,89		223 644,20
	Lindsell Train - GL-Equity EUR	181 784,52	EUR	1,17	1,17		212 160,71
	M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	34 271,14	EUR	9,37	9,37		321 175,40
	MAN GLG European Inc Opportunities	2 471,13	EUR	79,62	79,62		196 751,37
	Man GLG Innovation Equity Alternative IN H EUR Acc	1 596,90	EUR	108,41	108,41		173 119,93
	ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	1 893,86	EUR	29,36	29,36		55 603,69
	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	3 209,00	USD	18,18	20,06		52 879,03
	Pick US iShares MSCI Global Metals & Mining Producers	4 152,00	USD	19,30	21,29		72 633,10
	SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	6 575,00	EUR	26,88	26,88		176 742,58
	Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	42 662,89	EUR	2,05	2,05		87 441,86
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	9 152,00	USD	13,00	14,34		107 839,85
	US NATURAL GAS FUND LP	2 811,00	USD	12,55	13,85		31 976,02
	VECTOR FUND - NAVIGATOR -II	194,86	EUR	1 473,29	1 473,29		287 082,34
	VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	978,09	EUR	104,04	104,04		101 760,07
	Vaneck Vectors Gold Miners	2 734,00	USD	23,04	25,42		57 095,37
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	4 367,05	EUR	105,51	105,51		460 767,34
	Winton Diversified Fund UC- EUR	1 260,41	EUR	90,54	90,54		114 115,99
	WisdomTree Long NOK Short EUR	5 853,00	EUR	35,75	35,75		209 244,75
	iShares \$ TreasuryBond 1-3yr UCITS ETF USD (Acc) B	1 980,00	USD	114,39	126,20		205 292,53
	iShares Global Inflation Linked Govt Bond	1 574,00	EUR	146,91	146,91		231 236,34
	SUB-TOTAL						6 949 351,12
32	Fundos não harmonizados						
	BANIF Global Private Equity Fund - FCR	404 333,39	EUR	0,19	0,19		75 517,35
	SUB-TOTAL						75 517,35
4	Imobiliário						
42	U. P.'s de fundos de investimento imobiliário						
	CA Património Crescente	24 564,00	EUR	17,82	17,82		437 779,61
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	8 403,00	EUR	9,15	9,15		76 887,45
	SEB Immoinvest	13 074,00	EUR	1,84	1,84		24 056,16



SUB-TOTAL					538 723,22
5	Liquidez				
51	À vista				
512	Depósitos à ordem				
	BEVA - €		EUR		38 853,30
	CGD-EUR		EUR		54 688,80
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR		171,58
	DERIVADOS - Golden Broker		EUR		15 278,44
	Golden Conta margem Forward USD		EUR		48 405,00
	Millenium bcp		EUR		1 247 946,35
SUB-TOTAL					1 405 343,47
7	Operações com produtos derivados				
72	Fora de mercado regulamentado				
721	Forwards				
	EUR/USD 22-04-2020 1.0707 BUY	1,00	EUR	11 761,48	11 761,48
SUB-TOTAL					11 761,48
9	Outros valores a regularizar				-17 414,40
TOTAL DE APLICAÇÕES					9 314 328,61
TOTAL DO FUNDO					9 296 914,21

Lisboa, 31 de Março de 2020