

Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Equilibrada

Valor Patrimonial Unitário em 31/03/2020

5,68865 EUR

N.º Unidades de Participação em circulação

782 880,53275

| | | | | | | |
|------------|--|------------|-----|----------|----------|-------------------|
| 1 | Valores mobiliários cotados | | | | | |
| 11 | Mercado cot. ofic. de B.V. Port. | | | | | |
| 114 | Ações | | | | | |
| | 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 | 533,82 | 55 013,72 |
| | EIB 1,125% 15/05/2020 NOK | 600 000,00 | NOK | 99,97 | 1 147,76 | 515,64 |
| | EIB 1,50% 12/05/2022 NOK | 290 000,00 | NOK | 101,75 | 1 168,14 | 335,99 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 133 809,44 |
| 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 | Ações | | | | | |
| | ISHARES Eurostoxx Banks 30-15 | 9 298,00 | EUR | 5,30 | 5,30 | 49 242,21 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 49 242,21 |
| 3 | U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo | | | | | |
| 31 | Fundos harmonizados | | | | | |
| | BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov. | 1 850,48 | EUR | 181,18 | 181,18 | 335 269,60 |
| | Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return | 247,19 | EUR | 145,48 | 145,48 | 35 961,20 |
| | CANDRIAM Euro High Yield | 56,57 | EUR | 1 159,85 | 1 159,85 | 65 609,23 |
| | Central Fund Canada LTD | 7 719,00 | USD | 14,62 | 16,13 | 102 288,85 |
| | ComStage Bund-Future Short UCITS ETF | 7 150,00 | EUR | 51,60 | 51,60 | 368 925,70 |
| | ETF WTI CRUDE OIL (EUR) | 6 667,00 | EUR | 2,76 | 2,76 | 18 400,92 |
| | ETFS AGRICULTURE | 11 237,00 | EUR | 3,36 | 3,36 | 37 745,08 |
| | ETFS AGRICULTURE USD | 1 959,00 | USD | 3,70 | 4,08 | 6 561,87 |
| | ETFS Copper | 1 855,00 | EUR | 18,56 | 18,56 | 34 425,09 |
| | ETFS Copper USD | 324,00 | USD | 20,42 | 22,53 | 5 996,81 |
| | FUNDSMITH Equity Fund | 4 629,38 | EUR | 37,73 | 37,73 | 174 684,10 |
| | ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED | 1 236,00 | EUR | 41,41 | 41,41 | 51 182,76 |
| | Ishares MSCI Emerging Markets USD | 2 446,00 | EUR | 25,13 | 25,13 | 61 467,98 |
| | JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY | 12 535,67 | EUR | 13,26 | 13,26 | 166 222,98 |
| | Jupiter Dynamic Bond Fund | 8 336,00 | EUR | 10,41 | 10,41 | 86 777,76 |
| | KEMPEN Euro Credit | 60,55 | EUR | 1 408,52 | 1 408,52 | 85 285,89 |
| | L&G Emerging Markets Short Duration | 108 948,72 | EUR | 0,89 | 0,89 | 97 160,47 |
| | Lindsell Train - GL-Equity EUR | 157 777,86 | EUR | 1,17 | 1,17 | 184 142,53 |
| | M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC | 9 942,60 | EUR | 9,37 | 9,37 | 93 178,08 |
| | MAN GLG European Inc Opportunities | 1 234,15 | EUR | 79,62 | 79,62 | 98 263,10 |
| | Man GLG Innovation Equity Alternative IN H EUR Acc | 746,48 | EUR | 108,41 | 108,41 | 80 925,90 |
| | ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR | 1 369,43 | EUR | 29,36 | 29,36 | 40 206,54 |
| | PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD | 2 457,00 | USD | 18,18 | 20,06 | 40 487,31 |
| | Pick US iShares MSCI Global Metals & Mining Producers | 4 042,00 | USD | 19,30 | 21,29 | 70 708,81 |
| | SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF | 3 237,00 | EUR | 26,88 | 26,88 | 87 013,80 |
| | Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund | 29 280,20 | EUR | 2,05 | 2,05 | 60 012,70 |
| | THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS | 5 473,00 | USD | 13,00 | 14,34 | 64 489,45 |
| | US NATURAL GAS FUND LP | 2 314,00 | USD | 12,55 | 13,85 | 26 322,49 |
| | VECTOR FUND - NAVIGATOR -II | 120,21 | EUR | 1 473,29 | 1 473,29 | 177 101,24 |
| | VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I) | 551,08 | EUR | 104,04 | 104,04 | 57 334,05 |
| | Vaneck Vectors Gold Miners | 1 820,00 | USD | 23,04 | 25,42 | 38 007,89 |



| | | | | | |
|---|------------|-----|----------|----------|---------------------|
| Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund | 1 516,81 | EUR | 105,51 | 105,51 | 160 038,20 |
| Winton Diversified Fund UC- EUR | 641,25 | EUR | 90,54 | 90,54 | 58 058,41 |
| WisdomTree Long NOK Short EUR | 2 853,00 | EUR | 35,75 | 35,75 | 101 994,75 |
| iShares Global Inflation Linked Govt Bond | 600,00 | EUR | 146,91 | 146,91 | 88 146,00 |
| SUB-TOTAL | | | | | 3 260 397,54 |
| 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 | 17,82 | 17,82 | 132 542,21 |
| SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN | 1 500,00 | EUR | 9,15 | 9,15 | 13 725,00 |
| SEB Immoinvest | 3 410,00 | EUR | 1,84 | 1,84 | 6 274,40 |
| SUB-TOTAL | | | | | 152 541,61 |
| 5 Liquidez | | | | | |
| 51 À vista | | | | | |
| 512 Depósitos à ordem | | | | | |
| BBVA - € | | EUR | | | 6 586,07 |
| CGD-EUR | | EUR | | | 55 379,74 |
| Cx. Crédito Agrícola Mútu | | EUR | | | 46,87 |
| DERIVADOS - Golden Broker | | EUR | | | 43 144,24 |
| Golden Conta margem Forward USD | | EUR | | | 23 205,00 |
| Millenium bcp | | EUR | | | 696 765,69 |
| SUB-TOTAL | | | | | 825 127,61 |
| 7 Operações com produtos derivados | | | | | |
| 72 Fora de mercado regulamentado | | | | | |
| 721 Forwards | | | | | |
| EUR/USD 22-04-2020 1.0707 BUY | 1,00 | EUR | 5 708,72 | 5 708,72 | 5 708,72 |
| SUB-TOTAL | | | | | 5 708,72 |
| 9 Outros valores a regularizar | | | | | -9 604,25 |
| TOTAL DE APLICAÇÕES | | | | | 4 463 134,44 |
| TOTAL DO FUNDO | | | | | 4 453 530,19 |

Lisboa, 31 de Março de 2020

