

Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Equilibrada

Valor Patrimonial Unitário em 29/02/2020 6,15191 EUR
N.º Unidades de Participação em circulação 743 023,4993

	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	458,50		64 051,01
EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	600 000,00	NOK	99,84	1 034,61	516,12	58 323,48
EIB 1,50% 12/05/2022 NOK	290 000,00	NOK	100,68	1 043,31	336,64	28 511,66
SUB-TOTAL						150 886,15
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	7 706,00	EUR	8,19	8,19		63 112,14
SPDR Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	1 728,00	EUR	36,63	36,63		63 288,00
iShares MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF	8 036,00	EUR	5,33	5,33		42 827,86
SUB-TOTAL						169 228,00
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	1 850,48	EUR	186,23	186,23		344 614,52
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	247,19	EUR	141,83	141,83		35 058,96
CANDRIAM Euro High Yield	90,67	EUR	1 293,00	1 293,00		117 232,43
Central Fund Canada LTD	7 719,00	USD	14,74	16,25		103 173,94
ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	6 669,00	EUR	51,07	51,07		340 559,15
ETF WTI CRUDE OIL (EUR)	6 667,00	EUR	5,98	5,98		39 861,99
ETFS AGRICULTURE	11 237,00	EUR	3,44	3,44		38 700,23
ETFS AGRICULTURE USD	1 959,00	USD	3,79	4,18		6 729,97
ETFS Copper	1 855,00	EUR	21,26	21,26		39 437,30
ETFS Copper USD	324,00	USD	23,30	25,69		6 845,61
FUNDSMITH Equity Fund	4 413,71	EUR	42,38	42,38		187 033,61
ISHARES EURO INFL GOVT	622,00	EUR	221,35	221,35		137 679,70
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	1 236,00	EUR	43,62	43,62		53 908,14
Ishares MSCI Emerging Markets USD	2 446,00	EUR	29,14	29,14		71 276,44
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	12 535,67	EUR	13,94	13,94		174 747,24
Jupiter Dynamic Bond Fund	8 336,00	EUR	11,04	11,04		92 029,44
KEMPEN Euro Credit	60,55	EUR	1 503,75	1 503,75		91 052,06
L&G Emerging Markets Short Duration	108 938,94	EUR	1,05	1,05		113 884,76
Lindsell Train - GL-Equity EUR	135 547,73	EUR	1,25	1,25		169 881,97
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	24 534,60	EUR	10,30	10,30		252 819,25
MAN GLG European Inc Opportunities	1 060,75	EUR	102,41	102,41		108 631,31
MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I	79,48	EUR	918,58	918,58		73 006,45
Man GLG Innovation Equity Alternative IN H EUR Acc	746,48	EUR	107,06	107,06		79 918,15
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	1 369,43	EUR	31,97	31,97		43 780,75
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	2 457,00	USD	17,28	19,06		38 499,97
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	3 237,00	EUR	29,59	29,59		95 789,30
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	29 280,20	EUR	2,32	2,32		67 824,65
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	5 473,00	USD	15,65	17,26		77 669,64



	US NATURAL GAS FUND LP	2 314,00	USD	13,10	14,45	27 488,19
	VECTOR FUND - NAVIGATOR -II	108,33	EUR	1 753,96	1 753,96	190 008,24
	VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	551,08	EUR	124,14	124,14	68 410,70
	Vaneck Vectors Gold Miners	1 820,00	USD	26,22	28,91	43 272,86
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 516,81	EUR	109,39	109,39	165 923,41
	Winton Diversified Fund UC- EUR	641,25	EUR	100,31	100,31	64 323,45
	iShares Global Inflation Linked Govt Bond	600,00	EUR	152,94	152,94	91 761,00
	SUB-TOTAL					3 652 834,78
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	17,76	17,76	132 063,27
	SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN	1 500,00	EUR	9,15	9,15	13 725,00
	SEB Immoinvest	3 410,00	EUR	2,14	2,14	7 304,22
	SUB-TOTAL					153 092,49
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			6 586,07
	CGD-EUR		EUR			90 665,72
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			46,87
	DERIVADOS - Golden Broker		EUR			699,39
	Derivados - Broker		USD			41 182,55
	Millenium bcp		EUR			247 705,98
	SUB-TOTAL					386 886,58
7	Operações com produtos derivados					
71	Em mercado regulamentado					
712	Opções					
	Puts SPY US 04/17/20- P 325	11,00	USD	3 100,00	3 418,61	30 921,88
	SUB-TOTAL					30 921,88
9	Outros valores a regularizar					-9 146,01
	TOTAL DE APLICAÇÕES					4 580 157,19
	TOTAL DO FUNDO					4 571 011,18

Lisboa, 29 de Fevereiro de 2020