

Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Equilibrada

Valor Patrimonial Unitário em 31/05/2020 5,94223 EUR
N.º Unidades de Participação em circulação 732674,2766

	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	556,85		52 738,60
EIB 1,50% 12/05/2022 NOK	290 000,00	NOK	102,57	1 112,42	20,84	27 444,67
SUB-TOTAL						80 183,27
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	9 298,00	EUR	5,63	5,63		52 375,63
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	2 282,00	EUR	19,13	19,13		43 659,22
Xtrackers S&P 500 Inverse Daily Swap UCITS ETF						
1C	13 823,00	EUR	11,18	11,18		154 513,49
SUB-TOTAL						250 548,34
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	1 850,48	EUR	182,35	182,35		337 434,66
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	247,19	EUR	147,85	147,85		36 547,04
CANDRIAM Euro High Yield	56,57	EUR	1 255,13	1 255,13		70 998,94
Central Fund Canada LTD	7 719,00	USD	16,43	18,20		114 470,59
ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	7 150,00	EUR	51,57	51,57		368 754,10
ETFS AGRICULTURE	11 237,00	EUR	3,10	3,10		34 800,99
ETFS AGRICULTURE USD	1 959,00	USD	3,44	3,81		6 090,54
ETFS Copper	1 855,00	EUR	19,83	19,83		36 777,23
ETFS Copper USD	324,00	USD	22,06	24,44		6 449,82
FUNDSMITH Equity Fund	4 629,38	EUR	42,82	42,82		198 247,64
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	1 236,00	EUR	45,91	45,91		56 738,58
Ishares MSCI Emerging Markets USD	2 446,00	EUR	26,84	26,84		65 638,41
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	12 535,67	EUR	13,78	13,78		172 741,53
Jupiter Dynamic Bond Fund	8 336,00	EUR	10,82	10,82		90 195,52
KEMPEN Euro Credit	60,55	EUR	1 460,28	1 460,28		88 419,95
L&G Emerging Markets Short Duration	108 968,53	EUR	0,99	0,99		107 878,84
Lindsell Train - GL-Equity EUR	157 777,86	EUR	1,31	1,31		206 846,77
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	9 942,60	EUR	9,97	9,97		99 174,46
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	422,63	EUR	140,79	140,79		59 502,22
MAN GLG European Inc Opportunities	1 234,15	EUR	95,64	95,64		118 034,20
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	1 369,43	EUR	33,18	33,18		45 437,77
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	2 457,00	USD	23,20	25,70		51 450,37



	Pick US iShares MSCI Global Metals & Mining Producers	4 042,00	USD	23,55	26,09	85 917,68
	SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	4 751,00	EUR	28,39	28,39	134 880,89
	Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	29 280,20	EUR	2,23	2,23	65 192,36
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	5 473,00	USD	14,05	15,57	69 406,01
	US NATURAL GAS FUND LP	2 314,00	USD	11,32	12,54	23 643,14
	VECTOR FUND - NAVIGATOR -II	120,21	EUR	1 656,89	1 656,89	199 171,43
	VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	551,08	EUR	113,36	113,36	62 470,09
	Vaneck Vectors Gold Miners	1 820,00	USD	34,32	38,02	56 378,56
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 516,81	EUR	107,50	107,50	163 056,65
	WisdomTree Long NOK Short EUR	4 671,00	EUR	37,68	37,68	176 012,62
	iShares Global Inflation Linked Govt Bond	972,00	EUR	152,32	152,32	148 050,18
	SUB-TOTAL					3 556 809,78
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	17,89	17,89	133 065,78
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	1 500,00	EUR	9,12	9,12	13 680,00
	SEB Immoinvest	3 410,00	EUR	1,97	1,97	6 700,65
	SUB-TOTAL					153 446,43
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			13 667,40
	CGD-EUR		EUR			68 149,03
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			46,87
	DERIVADOS - Golden Broker		EUR			43 144,24
	Golden Conta margem Forward USD		EUR			25 757,26
	Millenium bcp		EUR			130 135,01
	SUB-TOTAL					280 899,81
7	Operações com produtos derivados					
72	Fora de mercado regulamentado					
721	Forwards					
	EUR/USD 21/07/2020 (FWD EUR/USD 21/07/2020)	1,00	EUR	3 755,34	3 755,34	3 755,34
	SUB-TOTAL					3 755,34
9	Outros valores a regularizar					-8 232,44
	TOTAL DE APLICAÇÕES					4 361 950,28
	TOTAL DO FUNDO					4 353 717,84

Lisboa, 31 de Maio de 2020