

Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Garantida

Valor Patrimonial Unitário em 31/05/2020 6,48368 EUR
 N.º Unidades de Participação em circulação 1 137 423,39

	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	247038	EUR				0
Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est.						
12 Membro da UE						
122 Outros fundos públicos e equiparados						
EIB 0% 27/08/2021 BRL	335 000,00	BRL	92,94	556,85		51 963,03
EIB 1,50% 12/05/2022 NOK	190 000,00	NOK	102,57	1 112,42	13,65	17 980,99
SUB-TOTAL						69 944,02
123 Obrigações diversas						
ESF 6.875% 10/2019	100 000,00	EUR	0,01	0,01		10,00
OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	30 000,00	EUR	5,00	5,00		1 500,00
SUB-TOTAL						1 510,00
124 Acções						
ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	4 274,00	EUR	5,63	5,63		24 075,44
Xtrackers S&P 500 Inverse Daily Swap						
UCITS ETF 1C	21 989,00	EUR	11,18	11,18		245 793,04
SUB-TOTAL						269 868,48
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 917,76	EUR	182,35	182,35		532 052,81
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	614,68	EUR	147,85	147,85		90 880,44
Bluebay GLB SOV OPP-M EUR	1 214,65	EUR	97,17	97,17		118 027,64
CANDRIAM Euro High Yield	144,54	EUR	1 255,13	1 255,13		181 415,24
Candriam Long Short Global Credit	801,85	EUR	102,85	102,85		82 470,68
Central Fund Canada LTD	4 177,00	USD	16,43	18,20		61 943,73
ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	11 885,00	EUR	51,57	51,57		612 956,99
FUNDSMITH Equity Fund	1 594,79	EUR	42,82	42,82		68 294,97
GROUPAMA Trésorerie 1C	3,34	EUR	40 093,31	40 093,31		133 775,34
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	783,00	EUR	45,91	45,91		35 943,62
Ishares MSCI Emerging Markets USD	1 000,00	EUR	26,84	26,84		26 835,00
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	18 537,25	EUR	13,78	13,78		255 443,31
Jupiter Dynamic Bond Fund	15 183,00	EUR	10,82	10,82		164 280,06
KEMPEN Euro Credit	226,73	EUR	1 460,28	1 460,28		331 089,28
L&G Emerging Markets Short Duration	197 078,29	EUR	0,99	0,99		195 107,51
LYXOR ETF EuroMTS 1-3 Y	3 200,00	EUR	124,44	124,44		398 208,00
Lindsell Train - GL-Equity EUR	51 387,67	EUR	1,31	1,31		67 369,23
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	35 633,25	EUR	9,97	9,97		355 431,01
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	736,20	EUR	140,79	140,79		103 649,03
MAN GLG European Inc Opportunities	1 261,06	EUR	95,64	95,64		120 607,59
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	7 908,00	EUR	28,39	28,39		224 508,12
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	4 976,00	USD	14,05	15,57		63 103,29
VECTOR FUND - NAVIGATOR -II	36,73	EUR	1 656,89	1 656,89		60 849,29
VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	301,10	EUR	113,36	113,36		34 133,04
Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	3 721,00	EUR	107,50	107,50		400 007,93
WisdomTree Long NOK Short EUR	7 915,00	EUR	37,68	37,68		298 253,03
iShares \$ TreasuryBond 1-3yr UCITS ETF USD (Acc) B	3 035,00	USD	114,39	126,73		313 358,94



328 543,46
5 658 538,58

	iShares Global Inflation Linked Govt Bond	2 157,00	EUR	152,32	152,32	
	SUB-TOTAL					
4	Imobiliário					
42	U. P.'s de fundos de investimento imobiliário					
	CA Património Crescente	14 790,00	EUR	17,89	17,89	264 628,60
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	1 786,00	EUR	9,12	9,12	16 288,32
	SEB Immoinvest	1 022,00	EUR	1,97	1,97	2 008,23
	SUB-TOTAL					282 925,15
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			441,85
	CGD-EUR		EUR			579 910,65
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			106,98
	Millenium bcp		EUR			522 953,67
	SUB-TOTAL					1 103 413,15
52	A prazo					
521	Depósitos e outros equiparados					
9	Outros valores a regularizar	215 000,00	EUR			-11 513,08
	TOTAL DE APLICAÇÕES					7 386 199,38
	TOTAL DO FUNDO					7 374 686,30

Lisboa, 31 de Maio de 2020