

Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Ativa

Valor Patrimonial Unitário em 30/06/2020 5,0129
 N.º Unidades de Participação em circulação 567 101,2774

	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	160 956,00	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	150 000,00	BRL	96,17	590,75		23 485,69
SUB-TOTAL						23 485,69
123 Obrigações diversas						
OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	30 000,00	EUR	5,00	5,00		1 500,00
SUB-TOTAL						1 500,00
124 Acções						
ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	10 832,00	EUR	6,14	6,14		66 475,98
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	2 198,00	EUR	18,61	18,61		40 900,39
iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF						
USD	24 349,00	USD	4,80	5,39		104 133,57
SUB-TOTAL						211 509,94
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	461,56	EUR	184,51	184,51		85 162,99
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	335,63	EUR	149,39	149,39		50 139,77
Central Fund Canada LTD	4 011,00	USD	16,90	18,99		60 336,23
ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	2 465,00	EUR	51,17	51,17		126 143,91
ETFS AGRICULTURE	6 969,00	EUR	3,07	3,07		21 373,92
ETFS AGRICULTURE USD	2 519,00	USD	3,45	3,88		7 735,46
ETFS Copper	1 240,00	EUR	21,94	21,94		27 199,40
ETFS Copper USD	324,00	USD	24,67	27,72		7 116,08
FUNDSMITH Equity Fund	4 799,08	EUR	42,36	42,36		203 306,31
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	1 225,00	EUR	46,39	46,39		56 821,63
Ishares MSCI Emerging Markets USD	4 114,00	EUR	28,75	28,75		118 256,93
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	8 191,72	EUR	13,97	13,97		114 438,33
L&G Emerging Markets Short Duration	85 365,17	EUR	1,02	1,02		86 876,14
Lindsell Train - GL-Equity EUR	156 165,77	EUR	1,31	1,31		205 014,42
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	6 398,77	EUR	10,15	10,15		64 919,38
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	304,48	EUR	138,04	138,04		42 030,56
MAN GLG European Inc Opportunities	1 331,51	EUR	97,38	97,38		129 662,25
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	1 639,95	EUR	31,76	31,76		52 084,75
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	2 237,00	USD	23,50	26,40		46 792,11
Pick US iShares MSCI Global Metals & Mining						
Producers	3 377,00	USD	24,53	27,56		73 733,93
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	1 514,00	EUR	28,26	28,26		42 784,13
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	27 417,33	EUR	2,35	2,35		64 499,26
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	3 920,00	USD	14,60	16,40		50 942,20
US NATURAL GAS FUND LP	1 706,00	USD	10,26	11,53		15 579,92
VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	494,46	EUR	119,38	119,38		59 028,40
Vaneck Vectors Gold Miners	2 054,00	USD	36,68	41,21		67 060,77
SUB-TOTAL						1 879 039,18
32 Fundos não harmonizados						



	BANIF Global Private Equity Fund - FCR	83 333,33	EUR	0,19	0,19	15 564,17
	SUB-TOTAL					15 564,17
4	Imobiliário					
42	U. P.'s de fundos de investimento imobiliário					
	CA Património Crescente	2 694,00	EUR	17,95	17,95	48 345,18
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	500,00	EUR	9,11	9,11	4 555,00
	SEB Immoinvest	934,00	EUR	2,05	2,05	1 918,44
	SUB-TOTAL					54 818,62
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	CGD-EUR		EUR			470 553,17
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			365,34
	DERIVADOS - Golden Broker		EUR			39 856,66
	Golden Conta margem Forward	1,00	EUR	18 603,44	18 603,44	18 603,44
	Millenium bcp		EUR			142 913,74
	SUB-TOTAL					672 292,35
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	4 800,47	4 800,47	4 800,47
	EUR/USD 21/07/2020 (FWD EUR/USD 21/07/2020)	1,00	EUR	-2 021,63	-2 021,63	-2 021,63
	SUB-TOTAL					2 778,84
9	Outros valores a regularizar					-18 142,72
	TOTAL DE APLICAÇÕES					2 860 988,79
	TOTAL DO FUNDO					2 842 846,07

Lisboa, 30 de Junho de 2020