

Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Equilibrada

Valor Patrimonial Unitário em 31/07/2020 6,03024 EUR
N.º Unidades de Participação em circulação 745825,8415

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	96,46	593,59	53 293,60
	SUB-TOTAL					53 293,60
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	5,70	5,70	52 952,11
	SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	2 282,00	EUR	17,17	17,17	39 177,38
	iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF USD	19 974,00	USD	5,00	5,89	84 701,84
	SUB-TOTAL					176 831,33
3	U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo					
31	Fundos harmonizados					
	BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	1 850,48	EUR	187,07	187,07	346 168,92
	Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	559,30	EUR	152,24	152,24	85 147,83
	CANDRIAM Euro High Yield	56,57	EUR	1 287,51	1 287,51	72 830,58
	Central Fund Canada LTD	7 719,00	USD	19,67	23,17	128 875,62
	ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	7 150,00	EUR	50,82	50,82	363 391,60
	DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable	393,40	EUR	224,66	224,66	88 381,47
	ETFS AGRICULTURE	11 237,00	EUR	3,04	3,04	34 115,53
	ETFS AGRICULTURE USD	1 959,00	USD	3,59	4,23	5 969,45
	ETFS Copper	1 855,00	EUR	22,17	22,17	41 125,35
	ETFS Copper USD	324,00	USD	26,21	30,88	7 208,04
	FUNDSMITH Equity Fund	3 159,38	EUR	43,22	43,22	136 545,56
	ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	1 236,00	EUR	44,79	44,79	55 360,44
	Ishares MSCI Emerging Markets USD	2 446,00	EUR	29,60	29,60	72 389,37
	JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	12 535,67	EUR	14,16	14,16	177 505,09
	Jupiter Dynamic Bond Fund	8 336,00	EUR	11,01	11,01	91 779,36
	KEMPEN Euro Credit	60,55	EUR	1 504,65	1 504,65	91 106,56
	L&G Emerging Markets Short Duration	108 978,23	EUR	1,04	1,04	112 988,63
	Lindsell Train - CL-Equity EUR	101 861,86	EUR	1,30	1,30	132 888,98
	M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	9 942,60	EUR	10,33	10,33	102 745,84
	MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	422,63	EUR	142,59	142,59	60 262,95
	MAN GLG European Inc Opportunities	1 234,15	EUR	98,21	98,21	121 205,97
	ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	1 369,43	EUR	30,08	30,08	41 192,53
	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	2 457,00	USD	24,70	29,10	51 511,89
	Pick US iShares MSCI Global Metals & Mining Producers	4 042,00	USD	26,39	31,09	90 540,12
	SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	4 751,00	EUR	27,54	27,54	130 842,54
	Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	29 280,20	EUR	2,42	2,42	70 729,25
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	5 473,00	USD	15,00	17,67	69 682,24
	US NATURAL GAS FUND LP	2 314,00	USD	10,26	12,09	20 151,90
	VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	551,08	EUR	124,33	124,33	68 515,40
	Vaneck Vectors Gold Miners	1 820,00	USD	42,94	50,59	66 334,40



	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 516,81	EUR	108,97	108,97	165 286,35
	iShares Global Inflation Linked Govt Bond	1 299,00	EUR	151,94	151,94	197 370,06
	SUB-TOTAL					3 300 149,82
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	18,00	18,00	133 850,38
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	1 500,00	EUR	9,09	9,09	13 635,00
	SEB Immoinvest	3 410,00	EUR	1,40	1,40	4 784,23
	SUB-TOTAL					152 269,61
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			15 831,90
	CCD-EUR		EUR			109 128,69
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			46,87
	DERIVADOS - Golden Broker		EUR			37 360,33
	Derivados - Broker		USD			68,96
	Golden Conta margem Forward		EUR			29 143,67
	Millenium bcp		EUR			583 426,08
	SUB-TOTAL					775 006,50
52	A prazo					
521	Depósitos e outros equiparados					
7	Operações com produtos derivados	300 000,00	EUR			0,00
71	Em mercado regulamentado					
712	Opções					
	ECU0 Long Call - 09/10/2020	5,00	USD	2 837,50	3 342,95	12 042,35
	SUB-TOTAL					12 042,35
9	Outros valores a regularizar					-8 390,60
	TOTAL DE APLICAÇÕES					4 505 900,52
	TOTAL DO FUNDO					4 497 509,92

Lisboa, 31 de Julho de 2020