

Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Equilibrada

Valor Patrimonial Unitário em 30/06/2020 5,9849 EUR
N.º Unidades de Participação em circulação 735 924,2687

| | 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 | 96,17 | 590,75 | | 53 234,23 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 53 234,23 |
| 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 | 6,14 | 6,14 | | 57 061,83 |
| SPDR MSCI World Energy UCITS ETF | 2 282,00 | EUR | 18,61 | 18,61 | | 42 463,46 |
| iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF | | | | | | |
| USD | 19 974,00 | USD | 4,80 | 5,39 | | 85 422,97 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 184 948,26 |
| 3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo | | | | | | |
| 31 Fundos harmonizados | | | | | | |
| BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov. | 1 850,48 | EUR | 184,51 | 184,51 | | 341 431,70 |
| Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return | 559,30 | EUR | 149,39 | 149,39 | | 83 553,83 |
| CANDRIAM Euro High Yield | 56,57 | EUR | 1 258,53 | 1 258,53 | | 71 191,27 |
| Central Fund Canada LTD | 7 719,00 | USD | 16,90 | 18,99 | | 116 114,52 |
| ComStage Bund-Future Short UCITS ETF | 7 150,00 | EUR | 51,17 | 51,17 | | 365 894,10 |
| ETFS AGRICULTURE | 11 237,00 | EUR | 3,07 | 3,07 | | 34 463,88 |
| ETFS AGRICULTURE USD | 1 959,00 | USD | 3,45 | 3,88 | | 6 015,79 |
| ETFS Copper | 1 855,00 | EUR | 21,94 | 21,94 | | 40 689,43 |
| ETFS Copper USD | 324,00 | USD | 24,67 | 27,72 | | 7 116,08 |
| FUNDSMITH Equity Fund | 4 629,38 | EUR | 42,36 | 42,36 | | 196 117,20 |
| ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED | 1 236,00 | EUR | 46,39 | 46,39 | | 57 331,86 |
| ISHares MSCI Emerging Markets USD | 2 446,00 | EUR | 28,75 | 28,75 | | 70 310,27 |
| JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY | 12 535,67 | EUR | 13,97 | 13,97 | | 175 123,31 |
| Jupiter Dynamic Bond Fund | 8 336,00 | EUR | 10,86 | 10,86 | | 90 528,96 |
| KEMPEN Euro Credit | 60,55 | EUR | 1 481,87 | 1 481,87 | | 89 727,23 |
| L&G Emerging Markets Short Duration | 108 978,23 | EUR | 1,02 | 1,02 | | 110 907,14 |
| Lindsell Train - GL-Equity EUR | 157 777,86 | EUR | 1,31 | 1,31 | | 207 130,77 |
| M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC | 9 942,60 | EUR | 10,15 | 10,15 | | 100 873,65 |
| MAN AHL Trend Alternative IN HEUR | 422,63 | EUR | 138,04 | 138,04 | | 58 339,98 |
| MAN GLG European Inc Opportunities | 1 234,15 | EUR | 97,38 | 97,38 | | 120 181,62 |
| ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR | 1 369,43 | EUR | 31,76 | 31,76 | | 43 493,17 |
| PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD | 2 457,00 | USD | 23,50 | 26,40 | | 51 393,93 |
| Pick US iShares MSCI Global Metals & Mining Producers | 4 042,00 | USD | 24,53 | 27,56 | | 88 253,65 |
| SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF | 4 751,00 | EUR | 28,26 | 28,26 | | 134 258,51 |
| Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund | 29 280,20 | EUR | 2,35 | 2,35 | | 68 881,67 |
| THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS | 5 473,00 | USD | 14,60 | 16,40 | | 71 124,15 |
| US NATURAL GAS FUND LP | 2 314,00 | USD | 10,26 | 11,53 | | 21 132,43 |
| VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I) | 551,08 | EUR | 119,38 | 119,38 | | 65 787,57 |
| Vaneck Vectors Gold Miners | 1 820,00 | USD | 36,68 | 41,21 | | 59 420,94 |



| | | | | | | |
|------------|--|------------|-----|-----------|-----------|---------------------|
| | Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund | 1 516,81 | EUR | 108,14 | 108,14 | 164 027,40 |
| | iShares Global Inflation Linked Govt Bond | 972,00 | EUR | 152,80 | 152,80 | 148 521,60 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 3 259 337,61 |
| 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 | 17,95 | 17,95 | 133 460,68 |
| | SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN | 1 500,00 | EUR | 9,11 | 9,11 | 13 665,00 |
| | SEB Immoinvest | 3 410,00 | EUR | 2,05 | 2,05 | 7 004,14 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 154 129,82 |
| 5 | Liquidez | | | | | |
| 51 | À vista | | | | | |
| 512 | Depósitos à ordem | | | | | |
| | BBVA - € | | EUR | | | 13 667,40 |
| | CGD-EUR | | EUR | | | 87 568,99 |
| | Cx. Crédito Agrícola Mútuo | | EUR | | | 46,87 |
| | DERIVADOS - Golden Broker | | EUR | | | 43 144,24 |
| | Golden Conta margem Forward | | EUR | | | 25 757,26 |
| | Millenium bcp | | EUR | | | 550 797,10 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 720 981,86 |
| 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 | -2 786,92 | -2 786,92 | -2 786,92 |
| | EUR/USD 21/07/2020 (FWD EUR/USD 21/07/2020) | 1,00 | EUR | 6 669,89 | 6 669,89 | 6 669,89 |
| | SUB-TOTAL | | | | | 3 882,97 |
| 9 | Outros valores a regularizar | | | | | -8 418,99 |
| | TOTAL DE APLICAÇÕES | | | | | 4 412 822,06 |
| | TOTAL DO FUNDO | | | | | 4 404 403,07 |

Lisboa, 30 de Junho de 2020