

## Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Ativa

Valor Patrimonial Unitário em 31/08/2020 5,15287 EUR  
 N.º Unidades de Participação em circulação 566 734,81123

	Quantidade	Moeda	Cot. Moeda	Cot. Euro	Jur Dec	Valor (Euro)
<b>1 Valores mobiliários cotados</b>						
<b>11 Mercado cot. ofic. de B.V. Port.</b>						
BES	160 956,00	EUR				0,00
<b>114 Acções</b>						
<b>12 Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE</b>						
<b>122 Outros fundos públicos e equiparados</b>						
EIB 0% 27/08/2021 BRL	150 000,00	BRL	96,62	633,60		22 102,74
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>22 102,74</b>
<b>123 Obrigações diversas</b>						
OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	30 000,00	EUR	5,00	5,00		1 500,00
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>1 500,00</b>
<b>124 Acções</b>						
ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	10 832,00	EUR	6,03	6,03		65 295,30
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	2 198,00	EUR	17,39	17,39		38 218,82
iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF USD	24 349,00	USD	5,30	6,33		108 033,54
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>211 547,66</b>
<b>3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo</b>						
<b>31 Fundos harmonizados</b>						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	461,56	EUR	185,82	185,82		85 767,64
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	335,63	EUR	152,23	152,23		51 092,95
Central Fund Canada LTD	4 011,00	USD	20,52	24,50		68 947,50
ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	2 465,00	EUR	51,35	51,35		126 582,68
DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable	509,63	EUR	236,56	236,56		120 558,78
ETFS AGRICULTURE	6 969,00	EUR	3,17	3,17		22 109,15
ETFS AGRICULTURE USD	2 519,00	USD	3,76	4,49		7 934,23
ETFS Copper	1 240,00	EUR	22,97	22,97		28 482,80
ETFS Copper USD	324,00	USD	27,17	32,43		7 374,34
FUNDSMITH Equity Fund	3 880,08	EUR	45,27	45,27		175 638,42
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	1 225,00	EUR	47,51	47,51		58 205,87
Ishares MSCI Emerging Markets USD	4 114,00	EUR	30,07	30,07		123 687,41
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	8 191,72	EUR	14,13	14,13		115 749,00
L&G Emerging Markets Short Duration	85 380,42	EUR	1,05	1,05		89 675,05
Lindsell Train - GL-Equity EUR	125 597,77	EUR	1,34	1,34		168 891,32
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	6 398,77	EUR	10,35	10,35		66 245,85
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	304,48	EUR	141,29	141,29		43 020,12
MAN GLG European Inc Opportunities	1 331,51	EUR	101,51	101,51		135 161,38
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	1 639,95	EUR	33,09	33,09		54 265,88
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	2 237,00	USD	27,85	33,25		52 189,09
Pick US iShares MSCI Global Metals & Mining Producers	3 377,00	USD	27,81	33,20		78 672,07



	SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	1 514,00	EUR	27,19	27,19	41 162,63
	Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	27 417,33	EUR	2,45	2,45	67 073,75
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	3 920,00	USD	16,03	19,14	52 622,64
	VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	494,46	EUR	126,37	126,37	62 484,66
	Vaneck Vectors Gold Miners	2 054,00	USD	42,27	50,46	72 731,28
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>1 976 326,49</b>
<b>32</b>	<b>Fundos não harmonizados</b>					
	BANIF Global Private Equity Fund - FCR	83 333,33	EUR	0,19	0,19	15 564,17
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>15 564,17</b>
<b>4</b>	<b>Imobiliário</b>					
<b>42</b>	<b>U. P.'s de fundos de investimento imobiliário</b>					
	CA Património Crescente	2 694,00	EUR	18,03	18,03	48 578,48
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	500,00	EUR	9,08	9,08	4 540,00
	SEB Immoinvest	934,00	EUR	1,47	1,47	1 376,72
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>54 495,20</b>
<b>5</b>	<b>Liquidez</b>					
<b>51</b>	<b>À vista</b>					
<b>512</b>	<b>Depósitos à ordem</b>					
	CGD-EUR		EUR			374 211,96
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			365,34
	DERIVADOS - Golden Broker		EUR			35 281,32
	Derivados - Broker		USD			4,19
	Golden Conta margem Forward		EUR			21 029,87
	Millenium bcp		EUR			201 839,08
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>632 731,76</b>
<b>7</b>	<b>Operações com produtos derivados</b>					
<b>71</b>	<b>Em mercado regulamentado</b>					
<b>712</b>	<b>Opções</b>					
	ECU0 Long Call - 09/10/2020	4,00	USD	3 650,00	4 357,17	12 230,42
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>12 230,42</b>
<b>9</b>	<b>Outros valores a regularizar</b>					<b>-6 186,00</b>
	<b>TOTAL DE APLICAÇÕES</b>					<b>2 926 498,44</b>
	<b>TOTAL DO FUNDO</b>					<b>2 920 312,44</b>

Lisboa, 31 de Agosto de 2020