

Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 31/08/2020 1,38504 EUR
 N.º Unidades de Participação em circulação 6 476 460,01495

	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	555 681,00	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	610 000,00	BRL	96,62	633,60		89 884,48
SUB-TOTAL						89 884,48
123 Obrigações diversas						
ESF 6.875% 10/2019	200 000,00	EUR	0,01	0,01		20,00
OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	175 000,00	EUR	5,00	5,00		8 750,00
SONAE float MC 30/07/2025	200 000,00	EUR	102,33	102,33	161,83	204 817,83
SUB-TOTAL						213 587,83
124 Acções						
ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	10 991,00	EUR	6,03	6,03		66 253,75
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	2 500,00	EUR	17,39	17,39		43 470,00
iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF						
USD	25 485,00	USD	5,30	6,33		113 073,84
SUB-TOTAL						222 797,59
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	4 006,81	EUR	185,82	185,82		744 545,43
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	1 245,48	EUR	152,23	152,23		189 599,42
CANDRIAM Euro High Yield	155,03	EUR	1 301,68	1 301,68		201 795,55
Candriam Long Short Global Credit	473,38	EUR	104,33	104,33		49 388,15
Central Fund Canada LTD	14 108,00	USD	20,52	24,50		242 510,93
ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	14 760,00	EUR	51,35	51,35		757 955,52
DPAM INVEST B Equities NewGems						
Sustainable	514,10	EUR	236,56	236,56		121 616,44
ETFS AGRICULTURE	11 803,00	EUR	3,17	3,17		37 445,02
ETFS AGRICULTURE USD	1 959,00	USD	3,76	4,49		6 170,36
ETFS Copper	2 121,00	EUR	22,97	22,97		48 719,37
ETFS Copper USD	185,00	USD	27,17	32,43		4 210,66
FUNDSMITH Equity Fund	4 014,42	EUR	45,27	45,27		181 719,55
GROUPAMA Trésorerie IC	2,90	EUR	40 112,19	40 112,19		116 489,81
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	1 506,00	EUR	47,52	47,52		71 557,59
Ishares MSCI Emerging Markets USD	2 379,00	EUR	30,07	30,07		71 524,64
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	15 083,46	EUR	14,13	14,13		213 129,29
Jupiter Dynamic Bond Fund	31 345,56	EUR	10,98	10,98		344 174,25
KEMPEN Euro Credit	244,51	EUR	1 506,22	1 506,22		368 285,85
L&G Emerging Markets Short Duration	250 891,14	EUR	1,05	1,05		263 510,96
Lindsell Train - GL-Equity EUR	129 595,52	EUR	1,34	1,34		174 267,10
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	34 271,14	EUR	10,35	10,35		354 805,66
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	947,51	EUR	141,29	141,29		133 873,83
MAN GLG European Inc Opportunities	2 471,13	EUR	101,51	101,51		250 844,41
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	1 893,86	EUR	33,09	33,09		62 667,78
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	3 209,00	USD	27,85	33,25		74 865,79



	Pick US iShares MSCI Global Metals & Mining Producers	4 152,00	USD	27,81	33,20	96 726,81
	SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	10 483,00	EUR	27,19	27,19	285 011,80
	Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	42 662,89	EUR	2,45	2,45	104 370,49
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	9 152,00	USD	16,02	19,12	122 857,75
	VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	978,09	EUR	126,37	126,37	123 600,73
	Vaneck Vectors Gold Miners	2 734,00	USD	42,27	50,46	96 809,79
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	4 367,05	EUR	109,34	109,34	477 493,14
	iShares \$ TreasuryBond 1-3yr UCITS ETF USD (Acc) B	1 980,00	USD	114,49	136,67	189 898,38
	iShares Global Inflation Linked Govt Bond	2 602,00	EUR	149,99	149,99	390 273,98
	SUB-TOTAL					6 972 716,23
32	Fundos não harmonizados					
	BANIF Global Private Equity Fund - FCR	404 333,39	EUR	0,19	0,19	75 517,35
	SUB-TOTAL					75 517,35
4	Imobiliário					
42	U. P.'s de fundos de investimento imobiliário					
	CA Património Crescente	24 564,00	EUR	18,03	18,03	442 940,50
	SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN	8 403,00	EUR	9,08	9,08	76 299,24
	SEB Immoinvest	13 074,00	EUR	1,47	1,47	19 271,08
	SUB-TOTAL					538 510,82
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - EUR		EUR			-26,00
	BBVA - €		EUR			63 394,74
	CGD-EUR		EUR			99 611,91
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			171,58
	DERIVADOS - Golden Broker		EUR			4 919,19
	Derivados - Broker		USD			72,25
	Golden Conta margem Forward		EUR			60 613,35
	Millenium bcp		EUR			616 197,28
	SUB-TOTAL					844 954,30
7	Operações com produtos derivados					
71	Em mercado regulamentado					
712	Opções					
	ECU0 Long Call - 09/10/2020	9,00	USD	3 650,00	4 357,17	27 518,45
	SUB-TOTAL					27 518,45
9	Outros valores a regularizar					-15 347,87
	TOTAL DE APLICAÇÕES					8 985 487,05
	TOTAL DO FUNDO					8 970 139,18

Lisboa, 31 de Agosto de 2020