

## Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Ativa

Valor Patrimonial Unitário em 30/09/2020 5,07733  
 N.º Unidades de Participação em circulação 567 382,65088

	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>						
<b>114 Acções</b>						
BES	160 956,00	EUR				0,00
<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	470 000,00	BRL	96,85	637,16		69 188,21
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>69 188,21</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	5,30	5,30		57 431,26
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	2 198,00	EUR	15,29	15,29		33 616,21
iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF						
USD	24 349,00	USD	5,21	6,11		108 118,95
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>199 166,42</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	188,34	188,34		86 930,78
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	335,63	EUR	155,69	155,69		52 254,23
Central Fund Canada LTD	4 011,00	USD	18,34	21,50		62 755,52
ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	2 465,00	EUR	50,78	50,78		125 172,70
DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable	509,63	EUR	232,56	232,56		118 520,25
ETFS AGRICULTURE	6 969,00	EUR	3,26	3,26		22 743,33
ETFS AGRICULTURE USD	2 519,00	USD	3,83	4,49		8 235,88
ETFS Copper	1 240,00	EUR	23,22	23,22		28 792,80
ETFS Copper USD	324,00	USD	27,25	31,94		7 532,02
FUNDSMITH Equity Fund	3 880,08	EUR	44,88	44,88		174 146,14
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	1 225,00	EUR	48,56	48,56		59 486,00
Ishares MSCI Emerging Markets USD	4 114,00	EUR	30,39	30,39		125 024,46
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	8 191,72	EUR	14,16	14,16		115 994,76
L&G Emerging Markets Short Duration	85 388,30	EUR	1,04	1,04		88 991,69
Lindsell Train - GL-Equity EUR	125 597,77	EUR	1,34	1,34		167 848,86
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	304,48	EUR	138,32	138,32		42 115,81
MAN GLG European Inc Opportunities	1 331,51	EUR	98,34	98,34		130 940,50
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	1 639,95	EUR	32,67	32,67		53 577,10
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	2 497,00	USD	27,35	32,06		58 260,72
Pick US iShares MSCI Global Metals & Mining Producers	3 377,00	USD	26,78	31,39		77 151,00
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	2 667,00	EUR	27,30	27,30		72 814,43
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	27 417,33	EUR	2,53	2,53		69 431,64
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	3 920,00	USD	17,15	20,10		57 352,21
VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	494,46	EUR	122,04	122,04		60 343,65
Vaneck Vectors Gold Miners	2 054,00	USD	39,16	45,90		68 618,79
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>1 935 035,27</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	18,08	18,08		48 706,98
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	500,00	EUR	9,07	9,07		4 535,00
	SEB Immoinvest	934,00	EUR	1,49	1,49		1 386,99
	<b>SUB-TOTAL</b>						<b>54 628,97</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				377 528,32
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR				365,34
	DERIVADOS - Golden Broker		EUR				49 441,95
	Derivados - Broker		USD				4,27
	Golden Conta margem Forward	1,00	EUR	21 029,87	21 029,87		21 029,87
	Millenium USD		USD				-5 828,38
	Millenium bcp		EUR				166 625,97
	<b>SUB-TOTAL</b>						<b>609 167,34</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	837,50	981,72		2 857,89
	<b>SUB-TOTAL</b>						<b>2 857,89</b>
<b>9</b>	<b>Outros valores a regularizar</b>						<b>-6 320,91</b>
	<b>TOTAL DE APLICAÇÕES</b>						<b>2 887 108,27</b>
	<b>TOTAL DO FUNDO</b>						<b>2 880 787,36</b>

Lisboa, 30 de Setembro de 2020