

Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 30/09/2020 1,3733 EUR
 N.º Unidades de Participação em circulação 6379499,6586

	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	1 310 000,00	BRL	96,85	637,16		192 843,74
SUB-TOTAL						192 843,74
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	101,87	101,87	323,67	204 053,67
SUB-TOTAL						212 823,67
124 Acções						
ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	10 991,00	EUR	5,30	5,30		58 274,28
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	2 500,00	EUR	15,29	15,29		38 235,00
iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF USD	25 485,00	USD	5,20	6,10		113 163,22
SUB-TOTAL						209 672,50
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	4 006,81	EUR	188,34	188,34		754 642,60
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	1 245,48	EUR	155,69	155,69		193 908,78
CANDRIAM Euro High Yield	205,53	EUR	1 288,14	1 288,14		264 744,97
Candriam Long Short Global Credit	473,38	EUR	104,23	104,23		49 340,81
Central Fund Canada LTD	14 108,00	USD	18,34	21,50		220 731,71
ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	14 760,00	EUR	50,78	50,78		749 512,80
DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable	514,10	EUR	232,56	232,56		119 560,03
ETFS AGRICULTURE	11 803,00	EUR	3,26	3,26		38 519,09
ETFS AGRICULTURE USD	1 959,00	USD	3,83	4,49		6 404,96
ETFS Copper	2 121,00	EUR	23,22	23,22		49 249,62
ETFS Copper USD	185,00	USD	27,25	31,94		4 300,69
FUNDSMITH Equity Fund	4 014,42	EUR	44,88	44,88		180 175,60
GROUPAMA Trésorerie IC	2,90	EUR	40 106,73	40 106,73		116 473,95
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	1 506,00	EUR	48,56	48,56		73 131,36
Ishares MSCI Emerging Markets USD	2 379,00	EUR	30,39	30,39		72 297,81
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	15 083,46	EUR	14,16	14,16		213 581,79
Jupiter Dynamic Bond Fund	31 345,56	EUR	10,90	10,90		341 666,60
KEMPEN Euro Credit	294,85	EUR	1 507,12	1 507,12		444 374,33
L&G Emerging Markets Short Duration	250 914,31	EUR	1,04	1,04		261 502,90
Lindsell Train - GL-Equity EUR	129 595,52	EUR	1,34	1,34		173 191,45
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	947,51	EUR	138,32	138,32		131 059,72
MAN GLG European Inc Opportunities	1 979,13	EUR	98,34	98,34		194 627,64
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	1 893,86	EUR	32,67	32,67		61 872,36
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	5 724,00	USD	27,35	32,06		133 554,00
Pick US iShares MSCI Global Metals & Mining Producers	4 152,00	USD	26,78	31,39		94 856,67



	SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	11 420,00	EUR	27,30	27,30	311 788,84
	Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	27 899,89	EUR	2,53	2,53	70 653,68
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	9 152,00	USD	17,15	20,10	133 899,85
	VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	978,09	EUR	122,04	122,04	119 365,62
	Vaneck Vectors Gold Miners	2 734,00	USD	39,16	45,90	91 335,82
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	4 367,05	EUR	109,35	109,35	477 536,81
B	iShares \$ TreasuryBond 1-3yr UCITS ETF USD (Acc)	1 980,00	USD	114,51	134,23	193 423,19
	iShares Global Inflation Linked Govt Bond	2 959,00	EUR	151,18	151,18	447 341,62
	SUB-TOTAL					6 788 627,67
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	18,08	18,08	444 112,21
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	8 403,00	EUR	9,07	9,07	76 215,21
	SEB Immoinvest	13 074,00	EUR	1,49	1,49	19 414,89
	SUB-TOTAL					539 742,31
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			63 342,74
	CGD-EUR		EUR			8 243,99
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			171,58
	DERIVADOS - Golden Broker		EUR			48 394,80
	Derivados - Broker		USD			73,58
	Golden Conta margem Forward		EUR			60 613,35
	Millenium USD		USD			-56 378,32
	Millenium bcp		EUR			624 998,81
	SUB-TOTAL					749 460,53
7	Operações com produtos derivados					
71	Em mercado regulamentado					
712	Opções					
	ECU0 Long Call - 09/10/2020	9,00	USD	837,50	981,71	6 430,24
	SUB-TOTAL					6 430,24
9	Outros valores a regularizar					-14 418,50
	TOTAL DE APLICAÇÕES					8 775 118,01
	TOTAL DO FUNDO					8 760 699,51

Lisboa, 30 de Setembro de 2020