

Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Conservadora

 Valor Patrimonial Unitário em 31/05/2021 1,45059 EUR
 N.º Unidades de Participação em circulação 5 584 255,0493

	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	98,90	631,11	203 008,69
	SUB-TOTAL					203 008,69
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	101,23	101,23	203 012,03
	SUB-TOTAL				552,03	211 782,03
124	Acções					
	ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	10 991,00	EUR	9,61	9,61	105 678,46
	SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	6 321,00	EUR	23,85	23,85	150 724,25
	iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)	1 086,00	EUR	139,40	139,40	151 388,40
	iShares Edge MSCI EM Value	2 084,00	EUR	39,64	39,64	82 599,34
	iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF USD	17 547,00	USD	7,33	8,96	105 243,91
	SUB-TOTAL					595 634,36
3	U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo					
31	Fundos harmonizados					
	AMUNDI MSCI EM ASIA UCITS ETF	4 116,00	EUR	38,55	38,55	158 663,57
	BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	1 944,38	EUR	185,66	185,66	360 993,78
	Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	2 142,19	EUR	150,41	150,41	322 206,80
	CANDRIAM Euro High Yield	176,91	EUR	1 368,90	1 368,90	242 173,47
	Candriam Long Short Global Credit	1 257,47	EUR	105,56	105,56	132 738,74
	Central Fund Canada LTD	14 108,00	USD	20,15	24,64	232 452,65
	DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable	393,10	EUR	273,47	273,47	107 502,15
	FUNDSMITH Equity Fund	3 175,42	EUR	52,35	52,35	166 237,37
	JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	15 083,46	EUR	14,27	14,27	215 240,97
	KEMPEN Euro Credit	315,47	EUR	1 529,14	1 529,14	482 397,80
	L&G Emerging Markets Short Duration	202 491,46	EUR	1,10	1,10	222 679,85
	LYXOR BUND FUTURE DAILY(-1X) INVERSE UCITS ETF	12 089,00	EUR	51,54	51,54	623 067,06
	Lindsell Train - GL-Equity EUR	105 617,96	EUR	1,53	1,53	161 732,78
	MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	947,51	EUR	155,42	155,42	147 262,16
	MAN GLG European Inc Opportunities	1 636,32	EUR	116,70	116,70	190 958,19
	ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	2 943,15	EUR	40,68	40,68	119 727,37
	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	4 568,00	USD	38,40	46,96	143 433,74
	SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	11 716,00	EUR	27,60	27,60	323 408,46
	Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	27 899,89	EUR	3,05	3,05	85 030,49
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	7 413,00	USD	26,00	31,80	157 601,86
	Vaneck Vectors Gold Miners	2 734,00	USD	39,42	48,21	88 127,03
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	2 174,89	EUR	111,09	111,09	241 608,42
	iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist	89 061,00	EUR	4,57	4,57	406 884,08
	iShares Global Inflation Linked Govt Bond	2 946,00	EUR	152,93	152,93	450 531,78
	SUB-TOTAL					5 782 660,57
32	Fundos não harmonizados					
	BANIF Global Private Equity Fund - FCR	404 333,39	EUR	0,19	0,19	75 517,35
	INDICO ACCELERATION SUB-FUND I GENERAL	50 633,56	EUR	0,61	0,61	30 711,79
	SUB-TOTAL					106 229,14
4	Imobiliário					
42	U. P.'s de fundos de investimento imobiliário					
	CA Património Crescente	24 564,00	EUR	18,50	18,50	454 524,89
	SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN	8 403,00	EUR	6,38	6,38	53 611,14



15 231,21
523 367,24

	SEB Immoinvest	13 074,00	EUR	1,17	1,17	
	SUB-TOTAL					
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			448,00
	CGD-EUR		EUR			40 797,37
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			171,58
	GOLDEN CC EURO		EUR			305,01
	GOLDEN CONTA MARGEM EURO		EUR			34 579,42
	GOLDEN CONTA MARGEM USD		USD			6 350,45
	GOLDEN FUTURO		USD			-337,30
	GOLDEN INDICO		EUR			13 198,48
	Millenium bcp		EUR			575 655,63
	SUB-TOTAL					671 168,64
7	Operações com produtos derivados					
71	Em mercado regulamentado					
711	Futuros					
	E-mini EURUSD - Jun 21	6,00	USD	1,22	1,49	0,00
712	Opções					
	Put SPY US 10/15/21 P400	24,00	USD	1 100,00	1 345,24	21 587,28
	SUB-TOTAL					21 587,28
9	Outros valores a regularizar					-14 952,70
	TOTAL DE APLICAÇÕES					8 115 437,95
	TOTAL DO FUNDO					8 100 485,25

Lisboa, 31 de Maio de 2021