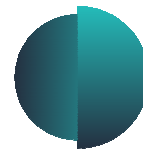


Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Equilibrada

| | | Valor Patrimonial Unitário em 30/06/2021 | | | 6,53771 | EUR | | | |
|------------------|--|--|-------|------------|---------------|---------|--------------|---------------------|--|
| | | N.º Unidades de Participação em circulação | | | 994 508,15544 | | | | |
| | | 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 | 269 682,00 | 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 | 740 000,00 | BRL | 99,20 | 584,56 | | 124 572,12 | | |
| SUB-TOTAL | | | | | | | | 124 572,12 | |
| 123 | Obrigações diversas | | | | | | | | |
| | OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021) | 60 000,00 | EUR | 5,00 | 5,00 | | 3 000,00 | | |
| SUB-TOTAL | | | | | | | | 3 000,00 | |
| 124 | Acções | | | | | | | | |
| | SPDR MSCI World Energy UCITS ETF | 6 737,00 | EUR | 25,20 | 25,20 | | 169 772,40 | | |
| | iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc) | 1 038,00 | EUR | 140,24 | 140,24 | | 145 569,12 | | |
| | iShares Edge MSCI EM Value | 3 238,00 | EUR | 40,06 | 40,06 | | 129 714,28 | | |
| | iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF USD | 23 900,00 | USD | 7,34 | 8,70 | | 147 906,52 | | |
| SUB-TOTAL | | | | | | | | 592 962,32 | |
| 3 | U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo | | | | | | | | |
| 31 | Fundos harmonizados | | | | | | | | |
| | AMUNDI MSCI EM ASIA UCITS ETF | 3 330,00 | EUR | 39,84 | 39,84 | | 132 650,55 | | |
| | BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov. | 1 134,08 | EUR | 185,90 | 185,90 | | 210 824,91 | | |
| | Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return | 1 257,10 | EUR | 152,98 | 152,98 | | 192 311,16 | | |
| | CANDRIAM Euro High Yield | 116,83 | EUR | 1 376,21 | 1 376,21 | | 160 779,86 | | |
| | Central Fund Canada LTD | 20 341,00 | USD | 18,68 | 22,15 | | 320 428,60 | | |
| | DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable | 465,42 | EUR | 292,62 | 292,62 | | 136 190,91 | | |
| | FUNDSMITH Equity Fund | 3 941,12 | EUR | 55,42 | 55,42 | | 218 416,87 | | |
| | JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY | 18 360,91 | EUR | 14,46 | 14,46 | | 265 498,76 | | |
| | Jupiter Dynamic Bond Fund | 8 336,00 | EUR | 10,79 | 10,79 | | 89 945,44 | | |
| | KEMPEN Euro Credit | 169,08 | EUR | 1 533,44 | 1 533,44 | | 259 274,04 | | |
| | L&G Emerging Markets Short Duration | 118 305,57 | EUR | 1,10 | 1,10 | | 130 136,13 | | |
| | LYXOR BUND FUTURE DAILY(-1X) INVERSE | | | | | | | | |
| | UCITS ETF | 8 715,00 | EUR | 51,15 | 51,15 | | 445 807,11 | | |
| | Lindsell Train - GL-Equity EUR | 124 868,18 | EUR | 1,59 | 1,59 | | 198 540,40 | | |
| | MAN AHL Trend Alternative IN HEUR | 422,63 | EUR | 153,84 | 153,84 | | 65 017,55 | | |
| | MAN GLG European Inc Opportunities | 1 368,59 | EUR | 119,06 | 119,06 | | 162 944,68 | | |
| | ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR | 2 540,74 | EUR | 41,64 | 41,64 | | 105 796,22 | | |
| | PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD | 4 787,00 | USD | 36,45 | 43,22 | | 147 144,17 | | |
| | SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF | 8 705,00 | EUR | 28,19 | 28,19 | | 245 428,77 | | |
| | Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund | 36 631,97 | EUR | 3,14 | 3,14 | | 115 024,37 | | |
| | THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS | 7 227,00 | USD | 27,00 | 32,02 | | 164 552,28 | | |
| | Vaneck Vectors Gold Miners UCITS ETF | 4 097,00 | EUR | 30,32 | 30,32 | | 124 241,52 | | |
| | iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist | 70 286,00 | EUR | 4,58 | 4,58 | | 321 825,53 | | |
| | iShares Global Inflation Linked Govt Bond | 2 100,00 | EUR | 155,65 | 155,65 | | 326 865,00 | | |
| SUB-TOTAL | | | | | | | | 4 539 644,83 | |
| 32 | Fundos não harmonizados | | | | | | | | |
| | BANIF Global Private Equity Fund - FCR | 178 333,32 | EUR | 0,19 | 0,19 | | 33 307,31 | | |
| | INDICO ACCELERATION SUB-FUND I GENERAL | 25 750,78 | EUR | 0,61 | 0,61 | | 15 619,13 | | |
| SUB-TOTAL | | | | | | | | 48 926,44 | |
| 4 | Imobiliário | | | | | | | | |
| 42 | U. P.'s de fundos de investimento imobiliário | | | | | | | | |
| | CA Património Crescente | 9 090,00 | EUR | 18,59 | 18,59 | | 168 983,10 | | |
| | SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN | 1 500,00 | EUR | 6,37 | 6,37 | | 9 555,00 | | |
| | SEB Immoinvest | 3 410,00 | EUR | 1,19 | 1,19 | | 4 057,90 | | |
| SUB-TOTAL | | | | | | | | 182 596,00 | |
| 5 | Liquidez | | | | | | | | |
| 51 | À vista | | | | | | | | |
| 512 | Depósitos à ordem | | | | | | | | |
| | BBVA - € | | EUR | | | | 422,00 | | |
| | CGD-EUR | | EUR | | | | 826 483,96 | | |



| | | | | | | |
|---|-------|-----|--------|--------|--|---------------------|
| Cx. Crédito Agrícola Mútuo | | EUR | | | | 189,55 |
| GOLDEN CC EURO | | EUR | | | | 9 057,14 |
| GOLDEN CONTA MARGEM EURO | | EUR | | | | 29 058,60 |
| GOLDEN CONTA MARGEM USD | | USD | | | | 7,24 |
| GOLDEN FUTURO | | USD | | | | -9 882,42 |
| GOLDEN INDICO | | EUR | | | | 6 749,24 |
| Millenium bcp | | EUR | | | | 336 519,48 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 1 198 604,79 |
| 7 Operações com produtos derivados | | | | | | |
| 71 Em mercado regulamentado | | | | | | |
| 711 Futuros | | | | | | |
| E-mini EURUSD - Set 2021 | 5,00 | USD | 1,19 | 1,41 | | 0,00 |
| 712 Opções | | | | | | |
| Put SPY US10/15/21 P400 | 29,00 | USD | 702,00 | 832,44 | | 17 167,90 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 17 167,90 |
| 9 Outros valores a regularizar | | | | | | -205 664,84 |
| TOTAL DE APLICAÇÕES | | | | | | 6 707 474,40 |
| TOTAL DO FUNDO | | | | | | 6 501 809,56 |

Lisboa, 30 de Junho de 2021