

Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Garantida

Valor Patrimonial Unitário em 31/05/2021 6,66757 EUR
N.º Unidades de Participação em circulação 1182 056,2259

	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	247 038,00	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	965 000,00	BRL	98,90	631,11	149 544,57
	SUB-TOTAL					149 544,57
123	Obrigações diversas					
	ESF 6.875% 10/2019	100 000,00	EUR	0,01	0,01	10,00
	OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	30 000,00	EUR	5,00	5,00	1 500,00
	SONAE float MC 30/07/2025	200 000,00	EUR	101,23	101,23	552,03
	SUB-TOTAL					204 522,03
124	Acções					
	ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	4 274,00	EUR	9,62	9,62	41 094,51
	SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	3 726,00	EUR	23,85	23,85	88 846,47
	iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)	650,00	EUR	139,40	139,40	90 610,00
	iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF USD	8 495,00	USD	7,33	8,96	50 951,56
	SUB-TOTAL					271 502,54
3	U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo					
31	Fundos harmonizados					
	AMUNDI MSCI EM ASIA UCITS ETF	3 554,00	EUR	38,55	38,55	136 999,59
	BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 076,99	EUR	185,66	185,66	385 613,22
	Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	1 985,31	EUR	150,41	150,41	298 610,48
	CANDRIAM Euro High Yield	203,58	EUR	1 368,90	1 368,90	278 684,77
	Candriam Long Short Global Credit	2 236,16	EUR	105,56	105,56	236 049,26
	Central Fund Canada LTD	15 244,00	USD	20,15	24,64	251 170,13
	DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable	201,17	EUR	273,47	273,47	55 014,23
	FUNDSMITH Equity Fund	1 410,79	EUR	52,35	52,35	73 856,69
	JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	18 537,25	EUR	14,27	14,27	264 526,56
	Jupiter Dynamic Bond Fund	15 183,00	EUR	10,77	10,77	163 520,91
	KEMPEN Euro Credit	349,95	EUR	1 529,14	1 529,14	535 122,54
	L&G Emerging Markets Short Duration	197 293,13	EUR	1,10	1,10	216 963,26
	LYXOR BUND FUTURE DAILY(-1X) INVERSE UCITS					
ETF		11 885,00	EUR	51,54	51,54	612 552,90
	Lindsell Train - GL-Equity EUR	45 422,67	EUR	1,53	1,53	69 555,73
	MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	736,20	EUR	155,42	155,42	114 419,58
	MAN GLG European Inc Opportunities	1 131,15	EUR	116,70	116,70	132 004,85
EUR		3 016,58	EUR	104,02	104,02	313 784,24
	ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	1 878,97	EUR	40,68	40,68	76 436,31
	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	3 252,00	USD	38,40	46,96	102 111,76
	SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	11 219,00	EUR	27,60	27,60	309 689,28
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	4 976,00	USD	26,00	31,80	105 790,76
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	3 721,00	EUR	111,09	111,09	413 366,33
	iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist	85 495,00	EUR	4,57	4,57	390 592,46
	iShares Global Inflation Linked Govt Bond	3 087,00	EUR	152,93	152,93	472 094,91
	SUB-TOTAL					6 008 530,75
32	Fundos não harmonizados					
	INDICO ACCELERATION SUB-FUND I GENERAL	42 532,18	EUR	0,61	0,61	25 797,90
	SUB-TOTAL					25 797,90
4	Imobiliário					
42	U. P.'s de fundos de investimento imobiliário					
	CA Património Crescente	21 410,00	EUR	18,50	18,50	396 164,22
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	1 786,00	EUR	6,38	6,38	11 394,68
	SEB Immoinvest	1 022,00	EUR	1,17	1,17	1 190,63
	SUB-TOTAL					408 749,53
5	Liquidez					
51	À vista					



512	Depósitos à ordem						
	BBVA - €		EUR				448,00
	CGD-EUR		EUR				246 967,27
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR				132,72
	GOLDEN CC EURO		EUR				55 563,36
	GOLDEN CONTA MARGEM EURO		EUR				-22,62
	GOLDEN FUTURO		USD				-265,75
	GOLDEN INDICO		EUR				11 102,71
	Millenium USD		USD				0,02
	Millenium bcp		EUR				494 198,85
	SUB-TOTAL						808 124,56
7	Operações com produtos derivados						
71	Em mercado regulamentado						
711	Futuros						
	E-mini EURUSD - Jun 21	4,00	USD	1,22	1,49		0,00
712	Opções						
	Put SPY US 10/15/21 P400	16,00	USD	1 100,00	1 345,24		14 391,52
	SUB-TOTAL						14 391,52
9	Outros valores a regularizar						-9 715,82
	TOTAL DE APLICAÇÕES						7 891 163,40
	TOTAL DO FUNDO						7 881 447,58

Lisboa, 31 de Maio de 2021