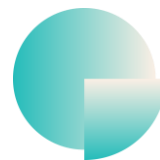


## Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 30/09/2021 1,46087 EUR  
 N.º Unidades de Participação em circulação 5 521 532,63644

	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	555 681,00	EUR	0,00	0,00		0,00
Greenvolt - Energias Renováveis S.A.	6 073,00	EUR	5,96	5,96		36 195,08
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>36 195,08</b>
<b>12 Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE</b>						
<b>123 Obrigações diversas</b>						
ESF 6.875% 10/2019	200000	EUR	0,01	0,01		20
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	100,73	100,73	450,00	201 910,00
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>210 680,00</b>
<b>124 Acções</b>						
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	6 321,00	EUR	26,49	26,49		167 443,29
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)	1 086,00	EUR	142,70	142,70		154 972,20
iShares Edge MSCI EM Value	2 084,00	EUR	38,06	38,06		79 306,62
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>401 722,11</b>
<b>3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo</b>						
<b>31 Fundos harmonizados</b>						
AMUNDI MSCI EM ASIA UCITS ETF	4 116,00	EUR	36,83	36,83		151 606,27
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	1 944,38	EUR	186,90	186,90		363 404,81
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	2 142,19	EUR	155,98	155,98		334 138,80
CANDRIAM Euro High Yield	176,91	EUR	1 386,29	1 386,29		245 249,95
Candriam Long Short Global Credit	1 257,47	EUR	105,86	105,86		133 115,99
Central Fund Canada LTD	17 424,00	USD	17,13	19,84		257 642,00
DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable	393,10	EUR	300,90	300,90		118 284,99
FUNDSMITH Equity Fund	4 773,63	EUR	55,91	55,91		266 899,86
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	15 083,46	EUR	14,55	14,55		219 464,34
KEMPEN Euro Credit	315,47	EUR	1 536,47	1 536,47		484 710,19
Kopernik Global All-Cap Equity Fund	1 072,23	EUR	204,56	204,56		219 335,27
L&G Emerging Markets Short Duration	202 563,38	EUR	1,10	1,10		223 589,46
LYXOR BUND FUTURE DAILY(-1X) INVERSE UCITS ETF	12 089,00	EUR	51,02	51,02		616 829,14
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	947,51	EUR	146,62	146,62		138 924,06
MAN GLG European Inc Opportunities	1 337,32	EUR	116,88	116,88		156 305,61
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	2 943,15	EUR	43,50	43,50		128 027,06
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	4 568,00	USD	36,10	41,82		142 345,82
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	11 716,00	EUR	27,99	27,99		327 919,12
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	27 899,89	EUR	3,31	3,31		92 329,10
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	7 413,00	USD	29,40	34,06		188 127,71
Vaneck Vectors Gold Miners UCITS ETF	3 548,00	EUR	27,36	27,36		97 073,28
Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	2 174,89	EUR	111,22	111,22		241 891,15
iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist	89 061,00	EUR	4,79	4,79		426 228,13
iShares Global Inflation Linked Govt Bond	2 946,00	EUR	160,25	160,25		472 096,50
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>6 045 538,61</b>
<b>32 Fundos não harmonizados</b>						
BANIF Global Private Equity Fund - FCR	404 333,39	EUR	0,19	0,19		75 517,35



INDICO ACCELERATION SUB-FUND I GENERAL	175 000,00	EUR	0,15	0,15	26 309,50
<b>SUB-TOTAL</b>					<b>101 826,85</b>
<b>4 Imobiliário</b>					
<b>42 U. P.'s de fundos de investimento imobiliário</b>					
CA Património Crescente	24 564,00	EUR	18,82	18,82	462 181,49
SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	8 403,00	EUR	6,35	6,35	53 359,05
SEB Immoinvest	13 074,00	EUR	1,04	1,04	13 531,59
<b>SUB-TOTAL</b>					<b>529 072,13</b>
<b>5 Liquidez</b>					
<b>51 À vista</b>					
<b>512 Depósitos à ordem</b>					
BBVA - €		EUR			2 222,86
CGD-EUR		EUR			26 293,86
Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			171,58
GOLDEN CC EURO		EUR			56 972,56
GOLDEN CONTA MARGEM EURO		EUR			32 578,75
GOLDEN CONTA MARGEM USD		USD			6 703,82
GOLDEN FUTURO		USD			-14 326,38
GOLDEN INDICO		EUR			6 002,28
Millenium USD		USD			0,01
Millenium bcp		EUR			636 470,18
<b>SUB-TOTAL</b>					<b>753 089,52</b>
<b>7 Operações com produtos derivados</b>					
<b>71 Em mercado regulamentado</b>					
<b>711 Futuros</b>					
E-mini EURUSD - Dez 2021	2,00	USD	1,16	1,34	0,00
<b>712 Opções</b>					
Put SPY US 10/15/21 P400	24,00	USD	128,00	148,29	2 651,75
<b>SUB-TOTAL</b>					<b>2 651,75</b>
<b>9 Outros valores a regularizar</b>					<b>-14 544,41</b>
<b>TOTAL DE APLICAÇÕES</b>					<b>8 080 776,05</b>
<b>TOTAL DO FUNDO</b>					<b>8 066 231,64</b>

Lisboa, 30 de Setembro de 2021