

## Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 31/12/2021 1,48337 EUR  
 N.º Unidades de Participação em circulação 5 599 901,41601

|   | 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                |
| <b>12 Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE</b> |            |       |            |           |          |                     |
| <b>123 Obrigações diversas</b>                                |            |       |            |           |          |                     |
| 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   | 100,36     | 100,36    | 1 125,00 | 201 851,00          |
| <b>SUB-TOTAL</b>  |            |       |            |           |          | <b>210621</b>       |
| <b>124 Acções</b>   |            |       |            |           |          |                     |
| SPDR MSCI World Energy UCITS ETF                              | 3 145,00   | EUR   | 27,91      | 27,91     |          | 87 761,23           |
| iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)                     | 1 086,00   | EUR   | 153,76     | 153,76    |          | 166 983,36          |
| iShares Edge MSCI EM Value                                    | 2 084,00   | EUR   | 38,62      | 38,62     |          | 80 473,66           |
| <b>SUB-TOTAL</b>  |            |       |            |           |          | <b>335 218,25</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   | 37,45      | 37,45     |          | 154 138,85          |
| BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.                                  | 1 944,38   | EUR   | 184,15     | 184,15    |          | 358 057,76          |
| Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return                      | 2 142,19   | EUR   | 164,91     | 164,91    |          | 353 268,55          |
| CANDRIAM Euro High Yield                                      | 176,91     | EUR   | 1 385,94   | 1 385,94  |          | 245 188,03          |
| Central Fund Canada LTD                                       | 17 424,00  | USD   | 17,74      | 20,17     |          | 271 824,09          |
| DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable                    | 393,10     | EUR   | 322,48     | 322,48    |          | 126 768,18          |
| FUNDSMITH Equity Fund   | 4 773,63   | EUR   | 61,02      | 61,02     |          | 291 302,66          |
| JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY                               | 15 083,46  | EUR   | 14,52      | 14,52     |          | 219 011,84          |
| KEMPEN Euro Credit  | 315,47     | EUR   | 1 526,15   | 1 526,15  |          | 481 454,54          |
| Kopernik Global All-Cap Equity Fund                           | 1 072,23   | EUR   | 213,01     | 213,01    |          | 228 390,25          |
| L&G Emerging Markets Short Duration                           | 202 617,18 | EUR   | 1,08       | 1,08      |          | 219 474,93          |
| LYXOR BUND FUTURE DAILY(-1X) INVERSE UCITS ETF                | 12 089,00  | EUR   | 50,84      | 50,84     |          | 614 653,12          |
| MAN AHL Trend Alternative IN HEUR                             | 947,51     | EUR   | 142,21     | 142,21    |          | 134 745,54          |
| MAN GLG European Inc Opportunities                            | 1 337,32   | EUR   | 123,17     | 123,17    |          | 164 717,33          |
| ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR                              | 2 943,15   | EUR   | 41,08      | 41,08     |          | 120 904,63          |
| PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD                                  | 4 568,00   | USD   | 41,10      | 46,74     |          | 165 102,78          |
| SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF                        | 11 716,00  | EUR   | 27,98      | 27,98     |          | 327 813,68          |
| Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund                   | 27 899,89  | EUR   | 3,44       | 3,44      |          | 96 042,57           |
| THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS                                | 7 413,00   | USD   | 27,80      | 31,61     |          | 181 227,98          |
| Vaneck Vectors Gold Miners UCITS ETF                          | 3 548,00   | EUR   | 29,69      | 29,69     |          | 105 340,12          |
| Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund               | 2 174,89   | EUR   | 110,28     | 110,28    |          | 239 846,76          |
| iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist                     | 89 061,00  | EUR   | 4,95       | 4,95      |          | 440 477,89          |
| iShares Global Inflation Linked Govt Bond                     | 2 946,00   | EUR   | 168,54     | 168,54    |          | 496 504,11          |
| <b>SUB-TOTAL</b>  |            |       |            |           |          | <b>6 036 256,19</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   | 0,18       | 0,18      |          | 31 225,95           |
| <b>SUB-TOTAL</b>  |            |       |            |           |          | <b>106 743,30</b>   |
| <b>4 Imobiliário</b>  |            |       |            |           |          |                     |
| <b>42 U. P.'s de fundos de investimento imobiliário</b>       |            |       |            |           |          |                     |
| CA Património Crescente                                       | 24 564,00  | EUR   | 19,12      | 19,12     |          | 469 602,27          |



|   |           |     |      |      |                     |
|---|-----------|-----|------|------|---------------------|
| SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN           | 8 403,00  | EUR | 6,37 | 6,37 | 53 527,11           |
| SEB Immoinvest                            | 13 074,00 | EUR | 1,08 | 1,08 | 14 054,55           |
| <b>SUB-TOTAL</b>                          |           |     |      |      | <b>537 183,93</b>   |
| <b>5 Liquidez</b>                         |           |     |      |      |                     |
| <b>51 À vista</b>                         |           |     |      |      |                     |
| <b>512 Depósitos à ordem</b>              |           |     |      |      |                     |
| BBVA - €                                  |           | EUR |      |      | 2 035,00            |
| Cx. Crédito Agrícola Mútuo                |           | EUR |      |      | 171,58              |
| GOLDEN CC EURO                            |           | EUR |      |      | 97 665,72           |
| GOLDEN CONTA MARGEM EURO                  |           | EUR |      |      | 14 919,43           |
| GOLDEN CONTA MARGEM USD                   |           | USD |      |      | 6 829,63            |
| GOLDEN FUTURO                             |           | USD |      |      | 1 179,26            |
| GOLDEN INDICO                             |           | EUR |      |      | 5 949,00            |
| Millenium bcp                             |           | EUR |      |      | 923 071,01          |
| <b>SUB-TOTAL</b>                          |           |     |      |      | <b>1 051 820,63</b> |
| <b>7 Operações com produtos derivados</b> |           |     |      |      |                     |
| <b>71 Em mercado regulamentado</b>        |           |     |      |      |                     |
| <b>711 Futuros</b>                        |           |     |      |      |                     |
| E-mini EURUSD - Mar 2022                  | 2,00      | USD | 1,14 | 1,30 | 0,00                |
| <b>9 Outros valores a regularizar</b>     |           |     |      |      | <b>28 895,81</b>    |
| <b>TOTAL DE APLICAÇÕES</b>                |           |     |      |      | <b>8 277 843,30</b> |
| <b>TOTAL DO FUNDO</b>                     |           |     |      |      | <b>8 306 739,11</b> |

Lisboa, 31 de Dezembro de 2021