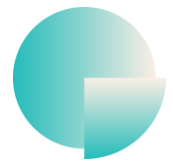


Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 31/01/2022 1,46398 EUR
 N.º Unidades de Participação em circulação 5 693 618,69283

	Quantidade	Moeda	Cot. Moeda	Cot. Euro	Jur Dec	Valor (Euro)
1 Valores mobiliários cotados						
11 Mercado cot. ofic. de B.V. Port.						
114 Ações						
BES	555 681,00	EUR				0,00
12 Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE						
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
SUB-TOTAL						8 770,00
124 Ações						
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	4 319,00	EUR	32,66	32,66		141 036,95
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)	1 086,00	EUR	155,72	155,72		169 111,92
iShares Edge MSCI EM Value	2 084,00	EUR	39,41	39,41		82 130,44
SUB-TOTAL						392 279,31
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
AMUNDI MSCI EM ASIA UCITS ETF	4 436,00	EUR	36,83	36,83		163 364,13
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	1 944,38	EUR	183,66	183,66		357 105,01
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	2 142,19	EUR	157,14	157,14		336 623,74
CANDRIAM Euro High Yield	176,91	EUR	1 363,13	1 363,13		241 152,69
Central Fund Canada LTD	17 424,00	USD	17,34	19,49		268 867,41
DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable	393,10	EUR	288,98	288,98		113 599,19
FUNDSMITH Equity Fund	4 773,63	EUR	56,07	56,07		267 677,01
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	15 083,46	EUR	14,34	14,34		216 296,82
KEMPEN Euro Credit	315,47	EUR	1 510,38	1 510,38		476 479,58
Kopernik Global All-Cap Equity Fund	1 072,23	EUR	210,02	210,02		225 189,75
L&G Emerging Markets Short Duration	202 617,18	EUR	1,07	1,07		216 212,79
LYXOR BUND FUTURE DAILY(-1X) INVERSE UCITS ETF	12 089,00	EUR	51,58	51,58		623 550,62
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	947,51	EUR	135,42	135,42		128 311,94
MAN GLG European Inc Opportunities	1 337,32	EUR	121,56	121,56		162 564,25
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	2 943,15	EUR	39,75	39,75		116 990,24
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	4 901,00	USD	37,25	41,86		162 462,15
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	11 716,00	EUR	28,24	28,24		330 871,56
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	27 899,89	EUR	3,23	3,23		90 010,62
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	7 645,00	USD	24,20	27,19		164 639,51
Vaneck Vectors Gold Miners UCITS ETF	3 842,00	EUR	28,66	28,66		110 111,72
Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	2 174,89	EUR	109,46	109,46		238 063,35
iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist	89 061,00	EUR	5,05	5,05		449 348,37
iShares Global Inflation Linked Govt Bond	2 946,00	EUR	165,60	165,60		487 857,60
SUB-TOTAL						5 947 350,05
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	175 000,00	EUR	0,18	0,18		31 225,25
SUB-TOTAL						106 742,60
4 Imobiliário						
42 U. P.'s de fundos de investimento imobiliário						
CA Património Crescente	24 564,00	EUR	19,17	19,17		470 999,96



SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN	8 403,00	EUR	6,35	6,35	53 359,05
SEB Immoinvest	13 074,00	EUR	0,65	0,65	8 537,32
SUB-TOTAL					532 896,33
5 Liquidez					
51 À vista					
512 Depósitos à ordem					
BBVA - €		EUR			8 425,39
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			6 911,18
GOLDEN FUTURO		USD			-464,10
GOLDEN INDICO		EUR			5 949,00
Millenium bcp		EUR			1 238 712,88
SUB-TOTAL					1 372 291,08
7 Operações com produtos derivados					
71 Em mercado regulamentado					
711 Futuros					
E-mini EURUSD - Mar 2022	2,00	USD	1,13	1,26	0,00
9 Outros valores a regularizar					-24 959,45
TOTAL DE APLICAÇÕES					8 360 329,37
TOTAL DO FUNDO					8 335 369,92

Lisboa, 31 de Janeiro de 2022