

## Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 31/08/2020 1,42663 EUR  
N.º Unidades de Participação em circulação 5 984 889,3927

	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
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>8 770,00</b>
<b>124 Acções</b>						
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	3 620,00	EUR	41,19	41,19		149 107,80
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)	781,00	EUR	157,22	157,22		122 788,82
iShares Edge MSCI EM Value	3 471,00	EUR	36,09	36,09		125 251,04
iShares MSCI World Value Factor UCITS	3 698,00	EUR	33,02	33,02		122 089,47
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>519 237,13</b>
<b>13 Mercado cot. ofic. de B.V. Estado não membro da UE</b>						
<b>134 Acções</b>						
7 Month EUR Booster Notes KraneShares CSI China Internet ETF	150 000,00	EUR	99,81	99,81		149 715,00
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>149 715,00</b>
<b>3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo</b>						
<b>31 Fundos harmonizados</b>						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 045,13	EUR	168,75	168,75		345 115,86
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	2 142,19	EUR	160,62	160,62		344 078,56
CANDRIAM Euro High Yield	183,66	EUR	1 250,59	1 250,59		229 680,86
FUNDSMITH Equity Fund	3 964,63	EUR	54,56	54,56		216 303,08
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	23 286,52	EUR	12,94	12,94		301 327,57
KEMPEN Euro Credit	203,47	EUR	1 408,32	1 408,32		286 550,87
Kopernik Global All-Cap Equity Fund	1 123,49	EUR	198,19	198,19		222 666,30
L&G Emerging Markets Short Duration	202 741,42	EUR	0,93	0,93		188 488,69
LYXOR BUND FUTURE DAILY(-1X) INVERSE UCITS ETF	10 008,00	EUR	53,95	53,95		539 951,62
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	947,51	EUR	151,77	151,77		143 803,74
MAN GLG European Inc Opportunities	533,32	EUR	109,97	109,97		58 648,87
Nordea 1 Low Duration European Covered Bond BI EUR	2 027,09	EUR	101,90	101,90		206 560,67
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	2 943,15	EUR	42,33	42,33		124 583,57
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	5 359,00	USD	32,40	33,12		169 863,79
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	11 716,00	EUR	27,41	27,41		321 135,56
Sprott Physical Gold and Silver Trust (CEF)	17 424,00	USD	16,73	17,10		285 177,89
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	27 899,89	EUR	3,19	3,19		88 944,84
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	8 665,00	USD	21,10	21,57		178 864,06
Vaneck Vectors Gold Miners UCITS ETF	3 969,00	EUR	27,56	27,56		109 385,64
Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	2 285,67	EUR	104,95	104,95		239 881,17
iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	39 325,00	EUR	4,31	4,31		169 439,63
iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist	78 469,00	EUR	5,24	5,24		410 926,46
iShares Global Inflation Linked Govt Bond	3 283,00	EUR	162,36	162,36		533 027,88
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>5 714 407,18</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	0,21	0,21		37 117,50

**SUB-TOTAL****112 634,85****4 Imobiliário****42 U. P.'s de fundos de investimento imobiliário**

CA Património Crescente	24 564,00	EUR	19,70	19,70	483 896,06
SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	8 403,00	EUR	4,90	4,90	41 174,70
SEB Immoinvest	13 074,00	EUR	0,72	0,72	9 413,28

**SUB-TOTAL****534 484,04****5 Liquidez****51 À vista****512 Depósitos à ordem**

BBVA - €		EUR			19 596,86
Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			75,58
GOLDEN CC EURO		EUR			69 753,29
GOLDEN CONTA MARGEM EURO		EUR			30 207,50
GOLDEN CONTA MARGEM USD		USD			7 597,71
GOLDEN FUTURO		USD			-18 503,39
GOLDEN INDICO		EUR			-38,88
Millenium USD		USD			0,01
Millenium bcp		EUR			1 404 224,52

**SUB-TOTAL****1 512 913,20****7 Operações com produtos derivados****71 Em mercado regulamentado****711 Futuros**

E-mini EURUSD -Sep 2022	10,00	USD	1,03	1,05	0,00
-------------------------	-------	-----	------	------	------

**9 Outros valores a regularizar****-13 913,98****TOTAL DE APLICAÇÕES****8 552 161,40****TOTAL DO FUNDO****8 538 247,42**

Lisboa, 31 de Julho de 2022