

## Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 31/07/2023 1,417 EUR  
 N.º Unidades de Participação em circulação 6 431 982,652

	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>111 Títulos de dívida pública</b>						
BUBILL 0 01/17/24	460 000,00	EUR	98,37	98,37		452 492,80
BUBILL 0 02/21/24	346 000,00	EUR	97,18	97,18		336 256,64
BUBILL 0 11/22/23	319 000,00	EUR	98,92	98,92		315 542,04
DBR 1 1/2 05/15/24	250000,00	EUR	98,5515	98,5515		247160
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>1 351 451,48</b>
<b>114 Acções</b>						
BES (NPR)	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	4,70	4,70		8 225,00
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>8 245,00</b>
<b>124 Acções</b>						
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	2 285,00	EUR	43,28	43,28		98 894,80
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)	751,00	EUR	166,12	166,12		124 756,12
iShares Edge MSCI EM Value	3 471,00	EUR	38,55	38,55		133 789,70
iShares MSCI World Value Factor UCITS	3 698,00	EUR	35,69	35,69		131 981,62
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>489 422,24</b>
<b>3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo</b>						
<b>31 Fundos harmonizados</b>						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 689,48	EUR	157,68	157,68		424 076,73
BSF European Opportunities Extension D2 EUR	297,38	EUR	590,54	590,54		175 614,79
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	2 210,75	EUR	156,14	156,14		345 186,51
CANDRIAM Euro High Yield	88,01	EUR	1 328,48	1 328,48		116 918,20
FUNDSMITH Equity Fund	4 216,64	EUR	56,66	56,66		238 911,45
ISHARES EURO INFL GOVT	2 613,00	EUR	225,08	225,08		588 134,04
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	28 208,39	EUR	12,42	12,42		350 348,20
KEMPEN Euro Credit	261,91	EUR	1 360,08	1 360,08		356 218,55
Kopernik Global All-Cap Equity Fund	1 228,72	EUR	205,21	205,21		252 147,31
KraneShares CSI China Internet ETF EUR	9 630,00	EUR	13,69	13,69		131 796,18
L&G Emerging Markets Short Duration	340 082,39	EUR	0,98	0,98		333 892,89
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	947,51	EUR	155,41	155,41		147 252,68
MONTLAKE-INVENOMIC US EQ. L/S(INS.PO.	1 064,79	EUR	129,24	129,24		137 611,25
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	2 943,15	EUR	53,70	53,70		158 047,20
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	5 878,00	USD	38,50	35,01		205 777,32
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	12 938,00	EUR	27,92	27,92		361 280,71
Sprott Physical Gold and Silver Trust (CEF)	23 096,00	USD	18,70	17,00		392 722,31
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	27 899,89	EUR	3,06	3,06		85 334,60
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	7 518,00	USD	19,80	18,00		135 355,12
Vaneck Vectors Gold Miners UCITS ETF	4 951,00	EUR	31,35	31,35		155 238,60
Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	2 687,78	EUR	104,06	104,06		279 690,07
iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	64 450,00	EUR	3,35	3,35		215 965,51
iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist	78 469,00	EUR	4,63	4,63		362 919,13
iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF	68 543,00	EUR	4,09	4,09		280 484,81
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>6 230 924,16</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	0,46	0,46	80 178,00
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>155 695,35</b>
<b>4</b>	<b>Imobiliário</b>					
<b>42</b>	<b>U. P.'s de fundos de investimento imobiliário</b>					
	CA Património Crescente	24 564,00	EUR	20,61	20,61	506 178,07
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	8 403,00	EUR	3,96	3,96	33 275,88
	SEB Immoinvest	13 074,00	EUR	0,76	0,76	9 936,24
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>549 390,19</b>
<b>5</b>	<b>Liquidez</b>					
<b>51</b>	<b>À vista</b>					
<b>512</b>	<b>Depósitos à ordem</b>					
	BBVA - €		EUR			28 411,65
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			225,58
	GOLDEN CC EURO		EUR			11 453,29
	GOLDEN CONTA MARGEM EURO		EUR			99 085,58
	GOLDEN CONTA MARGEM USD		USD			-1 909,08
	GOLDEN FUTURO		USD			265,12
	GOLDEN INDICO		EUR			-1,35
	Millenium bcp		EUR			196 166,50
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>333 697,29</b>
<b>7</b>	<b>Operações com produtos derivados</b>					
<b>71</b>	<b>Em mercado regulamentado</b>					
<b>711</b>	<b>Futuros</b>					
	E-Mini EURUSD - Set 2023	12,00	USD	1,10	1,00	
	<b>SUB-TOTAL</b>					
<b>712</b>	<b>Opções</b>					
	Put SPY US 17/11/23 P430	19	USD	489,9998263	445,5568421	<b>8465,58</b>
<b>9</b>	<b>Outros valores a regularizar</b>					<b>-10453,99</b>
	<b>TOTAL DE APLICAÇÕES</b>					<b>9 127 291,29</b>
	<b>TOTAL DO FUNDO</b>					<b>9 116 837,30</b>

Lisboa, 31 de Julho de 2023