

## Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 31/08/2023 1,400 EUR  
 N.º Unidades de Participação em circulação 6 436 154,868

	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	98,68	98,68		453 946,40
BUBILL 0 02/21/24	346 000,00	EUR	96,66	96,66		334 443,60
BUBILL 0 11/22/23	219 000,00	EUR	99,22	99,22		217 298,37
DBR 11/2 05/15/24	250000,00	EUR	98,701	98,701		247846,25
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>1 253 534,62</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	44,69	44,69		102 105,23
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)	751,00	EUR	162,12	162,12		121 752,12
iShares Edge MSCI EM Value	3 471,00	EUR	37,13	37,13		128 860,88
iShares MSCI World Value Factor UCITS	3 698,00	EUR	35,29	35,29		130 502,42
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>483 220,65</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	157,33	157,33		423 135,42
BSF European Opportunities Extension D2 EUR	297,38	EUR	589,24	589,24		175 228,19
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	2 210,75	EUR	158,16	158,16		349 652,22
CANDRIAM Euro High Yield	88,01	EUR	1 329,32	1 329,32		116 992,12
FUNDSMITH Equity Fund	4 216,64	EUR	56,25	56,25		237 184,74
ISHARES EURO INFL GOVT	2 613,00	EUR	224,23	224,23		585 912,99
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	28 208,39	EUR	12,41	12,41		350 066,12
KEMPEN Euro Credit	261,91	EUR	1 358,34	1 358,34		355 762,83
Kopernik Global All-Cap Equity Fund	1 228,72	EUR	207,47	207,47		254 925,68
KraneShares CSI China Internet ETF EUR	9 630,00	EUR	12,60	12,60		121 338,00
L&G Emerging Markets Short Duration	340 144,70	EUR	0,98	0,98		332 287,36
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	947,51	EUR	152,03	152,03		144 050,10
MONTLAKE-INVENOMIC US EQ. L/S (INS.PO.	1 064,79	EUR	131,12	131,12		139 611,56
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	2 943,15	EUR	55,39	55,39		163 021,12
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	5 878,00	USD	37,80	34,86		204 879,92
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	12 938,00	EUR	27,57	27,57		356 752,41
Sprott Physical Gold and Silver Trust (CEF)	23 707,00	USD	18,53	17,09		405 069,96
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	27 899,89	EUR	3,01	3,01		83 936,81
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	7 518,00	USD	19,80	18,26		137 260,49
Vaneck Vectors Gold Miners UCITS ETF	4 951,00	EUR	29,45	29,45		145 831,70
Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	2 687,78	EUR	104,24	104,24		280 173,87
iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	64 450,00	EUR	3,31	3,31		213 123,26
iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist	78 469,00	EUR	4,65	4,65		364 504,20
iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF	68 543,00	EUR	4,10	4,10		280 786,40
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>6 221 487,47</b>
<b>32 Fundos não harmonizados</b>						



INDICO ACCELERATION SUB-FUND I GENERAL	175 000,00	EUR	0,46	0,46	80 178,00
<b>SUB-TOTAL</b>					<b>80 178,00</b>
<b>4 Imobiliário</b>					
<b>42 U. P.'s de fundos de investimento imobiliário</b>					
CA Património Crescente	24 564,00	EUR	20,70	20,70	<b>508 393,74</b>
SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	8 403,00	EUR	3,97	3,97	33 359,91
SEB Immoinvest	13 074,00	EUR	0,76	0,76	9 988,54
<b>SUB-TOTAL</b>					<b>551 742,19</b>
<b>5 Liquidez</b>					
<b>51 À vista</b>					
<b>512 Depósitos à ordem</b>					
BBVA - €		EUR			28 196,40
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			-1 935,96
GOLDEN FUTURO		USD			-11 626,24
GOLDEN INDICO		EUR			-1,35
Millenium bcp		EUR			295 546,82
<b>SUB-TOTAL</b>					<b>420 944,12</b>
<b>7 Operações com produtos derivados</b>					
<b>71 Em mercado regulamentado</b>					
<b>711 Futuros</b>					
E-Mini EURUSD - Set 2023	12,00	USD	1,09	1,00	0,00
<b>712 Opções</b>					
Put SPY US 17/11/23 P430	19	USD	425,0001426	391,8926315	7445,96
<b>SUB-TOTAL</b>					<b>7445,96</b>
<b>9 Outros valores a regularizar</b>					<b>-15599,48</b>
<b>TOTAL DE APLICAÇÕES</b>					<b>9026798,01</b>
<b>TOTAL DO FUNDO</b>					<b>9011198,53</b>

Lisboa, 31 de Agosto de 2023