

Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Equilibrada

Valor Patrimonial Unitário em 31/08/2023 6,214 EUR

N.º Unidades de Participação em circulação 1 871 368,727

| | Quantidade | Moeda | Cot. Moeda | Cot. Euro | Jur Dec | Valor (Euro) |
|---|------------|-------|------------|-----------|---------|---------------------|
| 1 Valores mobiliários cotados | | | | | | |
| 11 Mercado cot. ofic. de B.V. Port. | | | | | | |
| 111 Títulos de dívida pública | | | | | | |
| BUBILL 0 01/17/24 | 600 000,00 | EUR | 98,68 | 98,68 | | 592 104,00 |
| BUBILL 0 02/21/24 | 306 000,00 | EUR | 96,66 | 96,66 | | 295 779,60 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 887883,6 |
| 114 Acções | | | | | | |
| BES (NPR) | 269 682,00 | EUR | | | | 0,00 |
| 12 Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE | | | | | | |
| 123 Obrigações diversas | | | | | | |
| OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021) | 60 000,00 | EUR | 4,70 | 4,70 | | 2 820,00 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 2 820,00 |
| 124 Acções | | | | | | |
| SPDR MSCI World Energy UCITS ETF | 3 918,00 | EUR | 44,69 | 44,69 | | 175 075,83 |
| iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc) | 1 310,00 | EUR | 162,12 | 162,12 | | 212 377,20 |
| iShares Edge MSCI EM Value | 4 816,00 | EUR | 37,13 | 37,13 | | 178 794,00 |
| iShares MSCI World Value Factor UCITS | 5 944,00 | EUR | 35,29 | 35,29 | | 209 763,76 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 776 010,79 |
| 3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo | | | | | | |
| 31 Fundos harmonizados | | | | | | |
| BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov. | 3 011,84 | EUR | 157,33 | 157,33 | | 473 853,42 |
| BSF European Opportunities Extension D2 EUR | 437,55 | EUR | 589,24 | 589,24 | | 257 821,96 |
| Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return | 2 985,09 | EUR | 158,16 | 158,16 | | 472 121,83 |
| CANDRIAM Euro High Yield | 115,25 | EUR | 1 329,32 | 1 329,32 | | 153 205,46 |
| Digital Funds Stars Europe I EUR | 254,05 | EUR | 153,79 | 153,79 | | 39 070,66 |
| FUNDSMITH Equity Fund | 9 218,89 | EUR | 56,25 | 56,25 | | 518 559,80 |
| ISHARES EURO INFL GOVT | 3 259,00 | EUR | 224,23 | 224,23 | | 730 765,57 |
| JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY | 33 246,74 | EUR | 12,41 | 12,41 | | 412 592,04 |
| KEMPEN Euro Credit | 264,24 | EUR | 1 358,34 | 1 358,34 | | 358 927,76 |
| Kopernik Global All-Cap Equity Fund | 2 568,00 | EUR | 207,47 | 207,47 | | 532 791,48 |
| KraneShares CSI China Internet ETF EUR | 19 310,00 | EUR | 12,60 | 12,60 | | 243 306,00 |
| L&G Emerging Markets Short Duration | 458 543,34 | EUR | 0,98 | 0,98 | | 447 950,99 |
| MAN AHL Trend Alternative IN HEUR | 1 054,24 | EUR | 152,03 | 152,03 | | 160 275,50 |
| MONTLAKE-INVENOMIC US EQ. L/S.(INS.PO. | 1 315,77 | EUR | 131,12 | 131,12 | | 172 520,00 |
| ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR | 4 161,75 | EUR | 55,39 | 55,39 | | 230 519,30 |
| PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD | 10 298,00 | USD | 37,80 | 34,86 | | 358 940,70 |
| SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF | 16 393,00 | EUR | 27,57 | 27,57 | | 452 020,58 |
| Sprott Physical Gold and Silver Trust (CEF) | 38 456,00 | USD | 18,53 | 17,09 | | 657 078,94 |
| Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund | 55 982,01 | EUR | 3,01 | 3,01 | | 168 421,88 |
| THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS | 12 833,00 | USD | 19,80 | 18,26 | | 234 299,52 |
| Vaneck Vectors Gold Miners UCITS ETF | 10 816,00 | EUR | 29,46 | 29,46 | | 318 585,28 |
| iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF | 124 590,00 | EUR | 3,31 | 3,31 | | 411 994,21 |
| iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist | 105 778,00 | EUR | 4,65 | 4,65 | | 491 359,97 |
| iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF | 62 668,00 | EUR | 4,10 | 4,10 | | 256 719,46 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 8 553 702,31 |
| 32 Fundos não harmonizados | | | | | | |
| INDICO ACCELERATION SUB-FUND I GENERAL | 89 000,00 | EUR | 0,46 | 0,46 | | 40 776,24 |
| INDICO VC FUND I - FCR CAT A | 250 000,00 | EUR | 1,11 | 1,11 | | 276 685,00 |
| Shilling - subs pendente | | EUR | | | | -67 500,00 |



| | | | | | |
|---|-----------|-----|-------------|-------------|--------------------|
| Shilling Fund | 750,00 | EUR | 100,72 | 100,72 | 75 540,00 |
| SUB-TOTAL | | | | | 325 501,24 |
| 4 Imobiliário | | | | | |
| 42 U. P.'s de fundos de investimento imobiliário | | | | | |
| CA Património Crescente | 16 722,00 | EUR | 20,70 | 20,70 | 346 090,22 |
| SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN | 1 500,00 | EUR | 3,97 | 3,97 | 5 955,00 |
| SEB Immoinvest | 3 410,00 | EUR | 0,76 | 0,76 | 2 605,24 |
| SUB-TOTAL | | | | | 354 650,46 |
| 5 Liquidez | | | | | |
| 51 À vista | | | | | |
| 512 Depósitos à ordem | | | | | |
| BBVA - € | | EUR | | | 4 633,81 |
| Cx. Crédito Agrícola Mútuo | | EUR | | | 207,59 |
| GOLDEN CC EURO | | EUR | | | 29 610,55 |
| GOLDEN CONTA MARGEM EURO | | EUR | | | 154 728,72 |
| GOLDEN CONTA MARGEM USD | | USD | | | -23 453,31 |
| GOLDEN FUTURO | | USD | | | -19 419,24 |
| GOLDEN INDICO | | EUR | | | 58,15 |
| Millenium bcp | | EUR | | | 587 488,05 |
| SUB-TOTAL | | | | | 733 854,32 |
| 7 Operações com produtos derivados | | | | | |
| 71 Em mercado regulamentado | | | | | |
| 711 Futuros | | | | | |
| E-Mini EURUSD - Set 2023 | 20 | USD | 1,08525 | 1,000709025 | 0 |
| 712 Opções | | | | | |
| Put SPY US 17/11/23 P430 | 49 | USD | 424,9999447 | 391,892449 | 19202,73 |
| SUB-TOTAL | | | | | 19202,73 |
| 9 Outros valores a regularizar | | | | | -24396,06 |
| TOTAL DE APLICAÇÕES | | | | | 11653625,45 |
| TOTAL DO FUNDO | | | | | 11629229,39 |

Lisboa, 31 de Agosto de 2023