

## Fundo de Pensões PPR SGF Poupança Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 30/09/2023 1,386 EUR  
 N.º Unidades de Participação em circulação 6 154 818,753

	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	290 000,00	EUR	98,93	98,93		286 891,20
BUBILL 0 02/21/24	346 000,00	EUR	96,52	96,52		333 945,36
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>620 836,56</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	47,35	47,35		108 194,75
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)	751,00	EUR	164,06	164,06		123 209,06
iShares Edge MSCI EM Value	3 471,00	EUR	38,08	38,08		132 175,68
iShares MSCI World Value Factor UCITS	3 698,00	EUR	35,67	35,67		131 907,66
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>495 487,15</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	152,89	152,89		411 194,14
BSF European Opportunities Extension D2 EUR	297,38	EUR	570,41	570,41		169 628,53
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	1 716,75	EUR	158,61	158,61		272 293,72
CANDRIAM Euro High Yield	88,01	EUR	1 326,34	1 326,34		116 729,86
FUNDSMITH Equity Fund	4 216,64	EUR	54,69	54,69		230 594,13
ISHARES EURO INFL GOVT	2 613,00	EUR	216,44	216,44		565 557,72
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	28 208,39	EUR	12,16	12,16		343 014,02
KEMPEN Euro Credit	261,91	EUR	1 342,31	1 342,31		351 564,41
Kopernik Global All-Cap Equity Fund	1 228,72	EUR	213,88	213,88		262 797,93
KraneShares CSI China Internet ETF EUR	9 630,00	EUR	12,32	12,32		118 641,60
L&G Emerging Markets Short Duration	340 144,70	EUR	0,96	0,96		327 695,40
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	947,51	EUR	160,77	160,77		152 331,34
MONTLAKE-INVENOMIC US EQ. L/S(INS.PO.	1 724,56	EUR	132,19	132,19		227 963,59
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	2 943,15	EUR	58,48	58,48		172 115,46
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	5 878,00	USD	36,40	34,42		202 341,22
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	12 938,00	EUR	27,29	27,29		353 090,96
Sprott Physical Gold and Silver Trust (CEF)	23 707,00	USD	17,32	16,38		388 309,38
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	27 899,89	EUR	3,00	3,00		83 691,29
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	7 518,00	USD	18,88	17,85		134 196,96
Vaneck Vectors Gold Miners UCITS ETF	4 951,00	EUR	27,79	27,79		137 588,29
Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	2 687,78	EUR	104,64	104,64		281 248,99
iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	64 450,00	EUR	3,12	3,12		201 232,24
iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist	78 469,00	EUR	4,73	4,73		371 244,69
iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF	68 543,00	EUR	3,99	3,99		273 623,66
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>6 148 689,53</b>



<b>32 Fundos não harmonizados</b>						
FCR PORTUGAL OPPORTUNITIES FUND	35,00	EUR	5 000,00	5 000,00		175 000,00
INDICO ACCELERATION SUB-FUND I GENERAL	175 000,00	EUR	0,46	0,46		80 178,00
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>255 178,00</b>
<b>4 Imobiliário</b>						
<b>42 U. P.'s de fundos de investimento imobiliário</b>						
CA Património Crescente	24 564,00	EUR	20,77	20,77		510 277,80
SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	8 403,00	EUR	3,98	3,98		33 443,94
SEB Immoinvest	13 074,00	EUR	0,76	0,76		9 870,87
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>553 592,61</b>
<b>5 Liquidez</b>						
<b>51 À vista</b>						
<b>512 Depósitos à ordem</b>						
BBVA - €		EUR				27 981,25
Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR				225,58
GOLDEN CC EURO		EUR				11 353,29
GOLDEN CONTA MARGEM EURO		EUR				80 389,19
GOLDEN CONTA MARGEM USD		USD				-1 985,51
GOLDEN FUTURO		USD				-12 051,99
GOLDEN INDICO		EUR				-32,21
Millenium bcp		EUR				340 518,37
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>446 397,97</b>
<b>7 Operações com produtos derivados</b>						
<b>71 Em mercado regulamentado</b>						
<b>711 Futuros</b>						
E-Mini EURUSD - Dez 2023	11	USD	1,06224	1,004560368		0,00
<b>712 Opções</b>						
Put SPY US 17/11/23 P430	19	USD	949,0001837	897,4694737		17051,92
<b>9 Outros valores a regularizar</b>						<b>-16112,59</b>
<b>TOTAL DE APLICAÇÕES</b>						<b>8545478,74</b>
<b>TOTAL DO FUNDO</b>						<b>8529366,15</b>

Lisboa, 30 de Setembro de 2023