

Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Equilibrada

Valor Patrimonial Unitário em 31/12/2019 8,96871 EUR
 N.º Unidades de Participação em circulação 438 300

	Quantidade	Moeda	Cot. Moeda	Cot. Euro	Jur Dec	Valor (Euro)
1 Valores mobiliários cotados						
11 Mercado cot. ofic. de B.V. Port.						
114 Acções						
BES	123 532,00	EUR				0,00
12 Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE						
122 Outros fundos públicos e equiparados						
EIB 0% 27/08/2021 BRL	290 000,00	BRL	92,94	418,45		59 860,44
EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	720 000,00	NOK	99,77	984,86	515,63	73 280,96
SUB-TOTAL						133 141,40
123 Obrigações diversas						
ESF 6,875% 10/2019	100 000,00	EUR	0,01	0,01		10,00
OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	16 000,00	EUR	5,00	5,00		800,00
SUB-TOTAL						810,00
124 Acções						
ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	6 563,00	EUR	9,48	9,48		62 217,24
SPDR Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	1 479,00	EUR	41,01	41,01		60 646,40
iShares MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF	7 000,00	EUR	5,84	5,84		40 852,70
SUB-TOTAL						163 716,34
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	1 648,66	EUR	182,09	182,09		300 205,23
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	239,48	EUR	138,98	138,98		33 282,93
CANDRIAM Euro High Yield	92,29	EUR	1 302,36	1 302,36		120 189,59
Central Fund Canada LTD	8 035,00	USD	14,66	16,42		105 165,68
ETFS AGRICULTURE	8 600,00	EUR	3,66	3,66		31 514,70
ETFS Copper	1 607,00	EUR	23,19	23,19		37 266,33
FUNDSMITH Equity Fund	3 804,88	EUR	42,63	42,63		162 205,08
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	749,00	EUR	49,78	49,78		37 285,22
Ishares MSCI Emerging Markets USD	1 971,00	EUR	32,02	32,02		63 111,42
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	10 761,53	EUR	13,52	13,52		145 495,89
Jupiter Dynamic Bond Fund	6 090,00	EUR	10,70	10,70		65 163,00
KEMPEN Euro Credit	55,12	EUR	1 485,87	1 485,87		81 901,15
La Française Euro Inflation	77,50	EUR	1 753,64	1 753,64		135 911,83
Lindsell Train - GL-Equity EUR	116 633,33	EUR	1,37	1,37		159 309,46
Lyxor Bund IX Inverse	5 598,00	EUR	43,67	43,67		244 436,67
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	20 868,10	EUR	10,56	10,56		220 394,23
MAN GLG European Inc Opportunities	918,56	EUR	110,41	110,41		101 418,10
MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I	69,68	EUR	1 137,43	1 137,43		79 257,86
Man GLG Innovation Equity Alternative IN H EUR Acc	656,00	EUR	107,23	107,23		70 342,88
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	935,61	EUR	36,33	36,33		33 990,64
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	2 340,00	USD	19,16	21,46		40 028,15
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	2 794,00	EUR	30,01	30,01		83 836,76



Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	25 151,97	EUR	2,43	2,43	61 084,08
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	4 748,00	USD	16,30	18,26	69 095,93
US NATURAL GAS FUND LP	1 749,00	USD	16,86	18,88	26 327,01
VECTOR FUND - NAVIGATOR -II	92,70	EUR	1 850,28	1 850,28	171 513,55
VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	495,80	EUR	127,75	127,75	63 338,45
Vaneck Vectors Gold Miners	2 168,00	USD	29,28	32,80	56 674,09
Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 259,64	EUR	109,02	109,02	137 325,84
Winton Diversified Fund UC- EUR	525,17	EUR	102,97	102,97	54 075,60
iShares \$ TreasuryBond 1-3yr UCITS ETF USD (Acc) B	1 186,00	USD	111,24	124,60	117 787,68
iShares J.P.Morgan \$EMBond EUR Hgd UCITS ETF(Dist)	1 051,00	EUR	94,57	94,57	99 390,13
SUB-TOTAL					3 208 325,16
32 Fundos não harmonizados					
BANIF Global Private Equity Fund - FCR	53 325,91	EUR	0,19	0,19	9 959,68
SUB-TOTAL					9 959,68
4 Imobiliário					
42 U. P.'s de fundos de investimento imobiliário					
CA Património Crescente	8 773,00	EUR	17,62	17,62	154 554,82
SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN	1 485,00	EUR	9,19	9,19	13 647,15
SEB Immoinvest	1 847,00	EUR	2,05	2,05	3 791,89
SUB-TOTAL					171 993,86
5 Liquidez					
51 À vista					
BIG Global Trade		EUR			500,00
SUB-TOTAL					500,00
512 Depósitos à ordem					
BBVA - €		EUR			7 042,06
BIG - Banco de Investimento Global		EUR			148 288,22
BIG USD		USD			607,01
CGD-EUR		EUR			37 006,08
Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			47,21
Millenium bcp		EUR			44 971,92
SUB-TOTAL					237 962,50
9 Outros valores a regularizar		EUR			4 573,78
TOTAL DE APLICAÇÕES					3 926 408,94
TOTAL DO FUNDO					3 930 982,72

Lisboa, 31 de Dezembro de 2019