

Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Equilibrada

Valor Patrimonial Unitário em 31/01/2020 8,95883 EUR
 N.º Unidades de Participação em circulação 440 216,721994

	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	441,51		56 734,00
EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	720 000,00	NOK	99,82	1 019,62	565,49	70 927,32
SUB-TOTAL						127 661,32
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	8,89	8,89		58 364,76
SPDR Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	1 479,00	EUR	40,06	40,06		59 241,35
iShares MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF	7 000,00	EUR	5,76	5,76		40 320,00
SUB-TOTAL						157 926,11
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	1 648,66	EUR	185,44	185,44		305 728,25
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	239,48	EUR	142,23	142,23		34 061,24
CANDRIAM Euro High Yield	92,29	EUR	1 299,77	1 299,77		119 950,57
Central Fund Canada LTD	8 035,00	USD	15,42	17,11		111 670,80
ETFs AGRICULTURE	8 600,00	EUR	3,52	3,52		30 263,40
ETFs Copper	1 607,00	EUR	21,03	21,03		33 787,18
FUNDSMITH Equity Fund	3 804,88	EUR	44,12	44,12		167 864,08
ISHARES EURO INFL GOVT	265,00	EUR	223,55	223,55		59 240,75
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	749,00	EUR	48,64	48,64		36 431,36
Ishares MSCI Emerging Markets USD	1 971,00	EUR	30,60	30,60		60 302,75
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	11 128,53	EUR	13,83	13,83		153 907,57
Jupiter Dynamic Bond Fund	6 090,00	EUR	10,95	10,95		66 685,50
KEMPEN Euro Credit	55,12	EUR	1 501,93	1 501,93		82 786,38
La Française Euro Inflation	77,50	EUR	1 784,88	1 784,88		138 333,02
Lindsell Train - GL-Equity EUR	116 633,33	EUR	1,38	1,38		160 837,36
Lyxor Bund 1X Inverse	6 748,00	EUR	42,50	42,50		286 790,00
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	20 868,10	EUR	10,52	10,52		219 567,86
MAN GLG European Inc Opportunities	918,56	EUR	108,89	108,89		100 021,89
MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I	69,68	EUR	1 026,72	1 026,72		71 543,18
Man GLG Innovation Equity Alternative IN H EUR Acc	656,00	EUR	108,73	108,73		71 326,88
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	935,61	EUR	34,89	34,89		32 643,37
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	2 340,00	USD	19,38	21,50		40 873,23



	SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	2 794,00	EUR	29,96	29,96	83 719,42
	Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	25 151,97	EUR	2,45	2,45	61 740,54
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	4 748,00	USD	17,05	18,92	72 963,30
	US NATURAL GAS FUND LP	1 749,00	USD	14,37	15,94	22 652,49
	VECTOR FUND - NAVIGATOR -II	92,70	EUR	1 878,55	1 878,55	174 134,07
	VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	495,80	EUR	128,34	128,34	63 630,97
	Vaneck Vectors Gold Miners	2 168,00	USD	28,99	32,16	56 646,99
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit					
Fund		1 259,64	EUR	109,41	109,41	137 817,10
	Winton Diversified Fund - UC- EUR	525,17	EUR	103,83	103,83	54 529,35
	iShares J.P.Morgan \$EMBond EUR Hgd UCITS					
ETF(Dist)		1 051,00	EUR	95,73	95,73	100 612,23
	SUB-TOTAL					3 213 063,08
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	17,69	17,69	155 216,30
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	1 485,00	EUR	9,17	9,17	13 617,45
	SEB Immoinvest	1 847,00	EUR	2,24	2,24	4 142,82
	SUB-TOTAL					172 976,57
5	Liquidez					
51	À vista					
	BIG Global Trade		EUR			500,00
	SUB-TOTAL					500,00
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			8 330,68
	BIG - Banco de Investimento Global		EUR			213 985,75
	CGD-EUR		EUR			58 072,95
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			47,21
	Millenium bcp		EUR			-9 420,04
	SUB-TOTAL					271 016,55
9	Outros valores a regularizar		EUR			-10 088,25
	TOTAL DE APLICAÇÕES					3 953 913,31
	TOTAL DO FUNDO					3 943 825,06

Lisboa, 31 de Janeiro de 2020