

Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Conservadora

		Valor Patrimonial Unitário em 31/03/2020			5,31437	EUR	
		N.º Unidades de Participação em circulação			1065111,37624		
		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	35 430,00	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	395 000,00	BRL	92,94	533,82		63 913,00
	EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	1 250 000,00	NOK	99,97	1 147,76	1 074,25	109 916,59
	SUB-TOTAL						173 829,59
123	Obrigações diversas						
	OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	2 000,00	EUR	5,00	5,00		100,00
	SUB-TOTAL						100,00
124	Acções						
	ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	7 160,00	EUR	5,30	5,30		37 919,36
	SUB-TOTAL						37 919,36
3	U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31	Fundos harmonizados						
	BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 642,47	EUR	181,18	181,18		478 763,26
	Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	502,87	EUR	145,48	145,48		73 157,53
	Bluebay GLB SOV OPP-M EUR	760,39	EUR	92,42	92,42		70 275,06
	CANDRIAM Euro High Yield	96,29	EUR	1 159,85	1 159,85		111 678,48
	Candriam Long Short Global Credit	743,89	EUR	101,63	101,63		75 601,44
	Central Fund Canada LTD	8 763,00	USD	14,62	16,13		116 123,49
	ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	9 665,00	EUR	51,60	51,60		498 694,67
	ETF WTI CRUDE OIL (EUR)	4 493,00	EUR	2,76	2,76		12 400,68
	ETFS AGRICULTURE	5 629,00	EUR	3,36	3,36		18 907,81
	ETFS Copper	1 339,00	EUR	18,56	18,56		24 849,16
	FUNDSMITH Equity Fund	3 854,73	EUR	37,73	37,73		145 453,61
	GROUPAMA Enterprises - IC	66,89	EUR	2 267,11	2 267,11		151 649,71
	GROUPAMA Trésorerie IC	3,08	EUR	40 103,45	40 103,45		123 699,09
	ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	1 049,00	EUR	41,41	41,41		43 439,09
	IsHares MSCI Emerging Markets USD	1 631,00	EUR	25,13	25,13		40 987,03
	JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	26 191,42	EUR	13,26	13,26		347 298,23
	KEMPEN Euro Credit	156,60	EUR	1 408,52	1 408,52		220 574,23
	La Française Euro Inflation	162,13	EUR	1 628,69	1 628,69		264 060,16
	Lindsell Train - GL-Equity EUR	118 440,75	EUR	1,17	1,17		138 232,19
	M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	21 281,98	EUR	9,37	9,37		199 446,20
	MAN GLG European Inc Opportunities	1 344,04	EUR	79,62	79,62		107 012,54
	Man GLG Innovation Equity Alternative IN H EUR Acc	1 065,00	EUR	108,41	108,41		115 456,65
	ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	705,56	EUR	29,36	29,36		20 715,15
	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	1 727,00	USD	18,18	20,06		28 458,11
	Pick US iShares MSCI Global Metals & Mining Producers	2 602,00	USD	19,30	21,29		45 518,14
	SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	4 395,00	EUR	26,88	26,88		118 142,00
	Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	20 322,82	EUR	2,05	2,05		41 653,64
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	6 039,00	USD	13,00	14,34		71 158,74
	US NATURAL GAS FUND LP	1 418,00	USD	12,55	13,85		16 130,20
	VECTOR FUND - NAVIGATOR -II	93,73	EUR	1 473,29	1 473,29		138 085,58
	VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	537,80	EUR	104,04	104,04		55 952,71
	Vaneck Vectors Gold Miners	1 784,00	USD	23,04	25,42		37 256,09
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	2 806,93	EUR	105,51	105,51		296 159,18
	Winton Diversified Fund UC- EUR	924,08	EUR	90,54	90,54		83 665,01
	WisdomTree Long NOK Short EUR	3 676,00	EUR	35,75	35,75		131 417,00
	iShares \$ TreasuryBond 1-3yr UCITS ETF USD (Acc) B	1 306,00	USD	114,39	126,20		135 410,12
	iShares Global Inflation Linked Govt Bond	1 019,00	EUR	146,91	146,91		149 701,29
	iShares J.P.Morgan \$EMBond EUR Hgd UCITS ETF(Dist)	1 831,00	EUR	80,59	80,59		147 551,14
	SUB-TOTAL						4 894 734,41
32	Fundos não harmonizados						
	BANIF Global Private Equity Fund - FCR	666,67	EUR	0,19	0,19		124,51
	SUB-TOTAL						124,51
4	Imobiliário						
42	U. P.'s de fundos de investimento imobiliário						
	CA Património Crescente	14 737,00	EUR	17,82	17,82		262 642,81
	SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN	421,00	EUR	9,15	9,15		3 852,15
	SEB Immoinvest	729,00	EUR	1,84	1,84		1 341,36
	SUB-TOTAL						267 836,32
5	Liquidez						
51	À vista						
	BIG Global Trade		EUR				500,00
	SUB-TOTAL						500,00
512	Depósitos à ordem						



BBVA - €		EUR			8 059,74
BIG - Banco de Investimento Global	1,00	EUR	120 125,92	120 125,92	120 125,92
BIG USD		USD			208,99
CGD-EUR		EUR			5 701,90
Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			25,49
DERIVADOS - Golden Broker		EUR			16 414,28
Golden Conta margem Forward USD		EUR			30 630,00
Millenium bcp		EUR			105 444,33
SUB-TOTAL					286 610,65
7 Operações com produtos derivados					
72 Fora de mercado regulamentado					
721 Forwards					
EUR/USD 22-04-2020 1.0707 BUY	1,00	EUR	7 512,16	7 512,16	7 512,16
SUB-TOTAL					7 512,16
9 Outros valores a regularizar					-8 770,97
TOTAL DE APLICAÇÕES					5 669 167,00
TOTAL DO FUNDO					5 660 396,03

Lisboa, 31 de Março de 2020