

Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 29/02/2020 5,69352 EUR

N.º Unidades de Participação em circulação 1 094 655,007

	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	458,50		74 412,20
EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	1 250 000,00	NOK	99,84	1 034,61	1 075,24	121 507,24
SUB-TOTAL						195 919,44
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	8,19	8,19		58 640,40
SPDR Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	1 178,00	EUR	36,63	36,63		43 144,25
iShares MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF	5 715,00	EUR	5,33	5,33		30 458,09
SUB-TOTAL						132 242,74
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 642,47	EUR	186,23	186,23		492 107,75
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	502,87	EUR	141,83	141,83		71 322,05
Bluebay GLB SOV OPP-M EUR	760,39	EUR	98,98	98,98		75 263,20
CANDRIAM Euro High Yield	139,69	EUR	1 293,00	1 293,00		180 615,29
Candriam Long Short Global Credit	743,89	EUR	103,88	103,88		77 275,19
Central Fund Canada LTD	8 763,00	USD	14,74	16,25		117 128,29
ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	9 665,00	EUR	51,07	51,07		493 552,89
ETF WTI CRUDE OIL (EUR)	4 493,00	EUR	5,98	5,98		26 863,65
ETFS AGRICULTURE	5 629,00	EUR	3,44	3,44		19 386,28
ETFS Copper	1 339,00	EUR	21,26	21,26		28 467,14
FUNDSMITH Equity Fund	3 854,73	EUR	42,38	42,38		163 346,50
GROUPAMA Enterprises - IC	66,89	EUR	2 268,66	2 268,66		151 753,39
GROUPAMA Trésorerie IC	3,08	EUR	40 157,86	40 157,86		123 866,92
ISHARES EURO INFL GOVT	994,00	EUR	221,35	221,35		220 021,90
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	1 049,00	EUR	43,62	43,62		45 752,14
Ishares MSCI Emerging Markets USD	1 631,00	EUR	29,14	29,14		47 527,34
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	26 191,42	EUR	13,94	13,94		365 108,39
KEMPEN Euro Credit	156,60	EUR	1 503,75	1 503,75		235 487,25
La Française Euro Inflation	162,13	EUR	1 765,53	1 765,53		286 246,09
Lindsell Train - GL-Equity EUR	118 440,75	EUR	1,25	1,25		148 441,79
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	33 628,98	EUR	10,30	10,30		346 533,19
MAN GLG European Inc Opportunities	1 344,04	EUR	102,41	102,41		137 643,24
MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I	57,61	EUR	918,58	918,58		52 922,07
Man GLG Innovation Equity Alternative IN H EUR Acc	1 065,00	EUR	107,06	107,06		114 018,90
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	705,56	EUR	31,97	31,97		22 556,65
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	1 727,00	USD	17,28	19,06		27 061,23
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	4 395,00	EUR	29,59	29,59		130 056,84
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	20 322,82	EUR	2,32	2,32		47 075,77
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	6 039,00	USD	15,65	17,26		85 701,99
US NATURAL GAS FUND LP	1 418,00	USD	13,10	14,45		16 844,54
VECTOR FUND - NAVIGATOR -II	93,73	EUR	1 753,96	1 753,96		164 391,65



	VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	537,80	EUR	124,14	124,14	66 762,49
	Vaneck Vectors Gold Miners	1 784,00	USD	26,22	28,91	42 416,91
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	2 806,93	EUR	109,39	109,39	307 050,07
	Winton Diversified Fund UC- EUR	924,08	EUR	100,31	100,31	92 693,24
	iShares \$ TreasuryBond 1-3yr UCITS ETF USD (Acc) B	1 306,00	USD	112,70	124,28	133 468,45
	iShares Global Inflation Linked Govt Bond	1 019,00	EUR	152,94	152,94	155 840,77
	iShares J.P.Morgan \$EMBond EUR Hgd UCITS ETF(Dist)	1 831,00	EUR	94,04	94,04	172 187,24
	SUB-TOTAL					5 484 758,68
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	17,76	17,76	261 693,75
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	421,00	EUR	9,15	9,15	3 852,15
	SEB Immoinvest	729,00	EUR	2,14	2,14	1 561,52
	SUB-TOTAL					267 107,42
5	Liquidez					
51	À vista					
	BIG Global Trade		EUR			500,00
	SUB-TOTAL					500,00
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			14 776,86
	BIG - Banco de Investimento Global	1,00	EUR	10 021,82	10 021,82	10 021,82
	CGD-EUR		EUR			39 793,98
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			25,49
	DERIVADOS - Golden Broker		EUR			916,73
	Derivados - Broker		USD			30 439,69
	Millenium bcp		EUR			44 952,42
	SUB-TOTAL					140 926,99
7	Operações com produtos derivados					
71	Em mercado regulamentado					
712	Opções					
	Puts SPY US 04/17/20- P 325	7,00	USD	3 100,00	3 418,61	19 677,56
	SUB-TOTAL					19 677,56
9	Outros valores a regularizar					-8 914,97
	TOTAL DE APLICAÇÕES					6 241 357,34
	TOTAL DO FUNDO					6 232 442,37

Lisboa, 29 de Fevereiro de 2020