

Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Equilibrada

Valor Patrimonial Unitário em 29-02-2020 8,79203 EUR
 N.º Unidades de Participação em circulação 441 271,0898

	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	458,50		54 631,74
EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	720 000,00	NOK	99,84	1 034,61	619,34	69 988,17
SUB-TOTAL						124 619,91
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	8,19	8,19		53 750,97
SPDR Russell 2000 US Small Cap UCITS ETF	1 479,00	EUR	36,63	36,63		54 168,38
iShares MSCI Europe Mid Cap UCITS ETF	7 000,00	EUR	5,33	5,33		37 306,50
SUB-TOTAL						145 225,85
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	1 648,66	EUR	186,23	186,23		307 030,70
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	239,48	EUR	141,83	141,83		33 965,45
CANDRIAM Euro High Yield	92,29	EUR	1 293,00	1 293,00		119 325,80
Central Fund Canada LTD	8 035,00	USD	14,74	16,25		107 397,67
ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	5 534,00	EUR	51,07	51,07		282 599,24
ETF WTI CRUDE OIL (EUR)	5 652,00	EUR	5,98	5,98		33 793,31
ETFS AGRICULTURE	8 600,00	EUR	3,44	3,44		29 618,40
ETFS Copper	1 607,00	EUR	21,26	21,26		34 164,82
FUNDSMITH Equity Fund	3 804,88	EUR	42,38	42,38		161 234,07
ISHARES EURO INFL GOVT	534,00	EUR	221,35	221,35		118 200,90
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	749,00	EUR	43,62	43,62		32 667,64
Ishares MSCI Emerging Markets USD	1 971,00	EUR	29,14	29,14		57 434,94
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	11 128,53	EUR	13,94	13,94		155 131,71
Jupiter Dynamic Bond Fund	6 090,00	EUR	11,04	11,04		67 233,60
KEMPEN Euro Credit	55,12	EUR	1 503,75	1 503,75		82 886,70
La Française Euro Inflation	77,50	EUR	1 765,53	1 765,53		136 833,34
Lindsell Train - GL-Equity EUR	116 633,33	EUR	1,25	1,25		146 176,55
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	20 868,10	EUR	10,30	10,30		215 037,39
MAN GLG European Inc Opportunities	918,56	EUR	102,41	102,41		94 069,63
MIMOSA Cap- AZVALOR Intl - I	69,68	EUR	918,58	918,58		64 008,13
Man GLG Innovation Equity Alternative IN H EUR Acc	656,00	EUR	107,06	107,06		70 231,36
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	935,61	EUR	31,97	31,97		29 911,39
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	2 340,00	USD	17,28	19,06		36 666,64
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	2 794,00	EUR	29,59	29,59		82 680,05



	Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	25 151,97	EUR	2,32	2,32	58 262,03
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	4 748,00	USD	15,65	17,26	67 380,86
	US NATURAL GAS FUND LP	1 749,00	USD	13,10	14,45	20 776,51
	VECTOR FUND - NAVIGATOR -II	92,70	EUR	1 753,96	1 753,96	162 585,08
	VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	495,80	EUR	124,14	124,14	61 548,61
	Vaneck Vectors Gold Miners	2 168,00	USD	26,22	28,91	51 547,01
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 259,64	EUR	109,39	109,39	137 791,91
	Winton Diversified Fund UC- EUR	525,17	EUR	100,31	100,31	52 679,18
	iShares Global Inflation Linked Govt Bond	516,00	EUR	152,94	152,94	78 914,46
	iShares J.P.Morgan \$EMBond EUR Hgd UCITS ETF(Dist)	1 051,00	EUR	94,04	94,04	98 836,04
	SUB-TOTAL					3 288 621,12
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	7 982,00	EUR	17,76	17,76	141 741,16
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	1 485,00	EUR	9,15	9,15	13 587,75
	SEB Immoinvest	1 847,00	EUR	2,14	2,14	3 956,27
	SUB-TOTAL					159 285,18
5	Liquidez					
51	À vista					
	BIG Global Trade		EUR			500,00
	SUB-TOTAL					500,00
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			13 191,46
	BIG - Banco de Investimento Global		EUR			6 150,34
	CGD-EUR		EUR			67 597,89
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			47,21
	DERIVADOS - Golden Broker		EUR			808,06
	Derivados - Broker		USD			35 713,73
	Millenium bcp		EUR			7 981,87
	SUB-TOTAL					131 490,56
7	Operações com produtos derivados					
71	Em mercado regulamentado					
712	Opções					
	Puts SPY US 04/17/20- P 325	9,00	USD	3 100,00	3 418,61	25 299,72
	SUB-TOTAL					25 299,72
9	Outros valores a regularizar					-6 144,81
	TOTAL DE APLICAÇÕES					3 885 812,02
	TOTAL DO FUNDO					3 879 667,21

Lisboa, 29 de Fevereiro de 2020