

Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Equilibrada

Valor Patrimonial Unitário em 31/03/2020 8,06864 EUR
 N.º Unidades de Participação em circulação 443 721,1456

	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						0,00
122 Outros fundos públicos e equiparados						
EIB 0% 27/08/2021 BRL	290 000,00	BRL	92,94	533,82		46 923,47
EIB 1,125% 15/05/2020 NOK	720 000,00	NOK	99,97	1 147,76	618,77	63 311,96
SUB-TOTAL						110 235,43
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	5,30	5,30		34 757,65
SUB-TOTAL						34 757,65
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	1 648,66	EUR	181,18	181,18		298 704,94
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	239,48	EUR	145,48	145,48		34 839,55
CANDRIAM Euro High Yield	44,99	EUR	1 159,85	1 159,85		52 177,01
Central Fund Canada LTD	8 035,00	USD	14,62	16,13		106 476,35
ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	5 534,00	EUR	51,60	51,60		285 543,33
ETF WTI CRUDE OIL (EUR)	5 652,00	EUR	2,76	2,76		15 599,52
ETFS AGRICULTURE	8 600,00	EUR	3,36	3,36		28 887,40
ETFS Copper	1 607,00	EUR	18,56	18,56		29 822,71
FUNDSMITH Equity Fund	3 804,88	EUR	37,73	37,73		143 572,58
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	749,00	EUR	41,41	41,41		31 016,09
Ishares MSCI Emerging Markets USD	1 971,00	EUR	25,13	25,13		49 531,23
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	11 128,53	EUR	13,26	13,26		147 564,31
Jupiter Dynamic Bond Fund	6 090,00	EUR	10,41	10,41		63 396,90
KEMPEN Euro Credit	55,12	EUR	1 408,52	1 408,52		77 637,62
La Française Euro Inflation	77,50	EUR	1 628,69	1 628,69		126 227,87
Lindsell Train - GL-Equity EUR	116 633,33	EUR	1,17	1,17		136 122,76
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	7 807,10	EUR	9,37	9,37		73 164,99
MAN GLG European Inc Opportunities	918,56	EUR	79,62	79,62		73 135,67
Man GLG Innovation Equity Alternative IN H EUR Acc	656,00	EUR	108,41	108,41		71 116,96
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	935,61	EUR	29,36	29,36		27 469,45
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	2 340,00	USD	18,18	20,06		38 559,34
Pick US iShares MSCI Global Metals & Mining Producers	3 211,00	USD	19,30	21,29		56 171,69
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	2 794,00	EUR	26,88	26,88		75 105,51
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	25 151,97	EUR	2,05	2,05		51 551,48
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	4 748,00	USD	13,00	14,34		55 946,63
US NATURAL GAS FUND LP	1 749,00	USD	12,55	13,85		19 895,43
VECTOR FUND - NAVIGATOR -II	92,70	EUR	1 473,29	1 473,29		136 568,09
VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	495,80	EUR	104,04	104,04		51 583,03
Vaneck Vectors Gold Miners	2 168,00	USD	23,04	25,42		45 275,33



Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 259,64	EUR	105,51	105,51	132 904,51
Winton Diversified Fund UC- EUR	525,17	EUR	90,54	90,54	47 548,28
WisdomTree Long NOK Short EUR	2 294,00	EUR	35,75	35,75	82 010,50
iShares Global Inflation Linked Govt Bond	516,00	EUR	146,91	146,91	75 805,56
iShares J.P.Morgan \$EMBond EUR Hgd UCITS ETF(Dist)	1 051,00	EUR	80,59	80,59	84 694,84
SUB-TOTAL					2 825 627,46
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	17,82	17,82	142 255,20
SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	1 485,00	EUR	9,15	9,15	13 587,75
SEB Immoinvest	1 847,00	EUR	1,84	1,84	3 398,48
SUB-TOTAL					159 241,43
5 Liquidez					
51 À vista					
BIG Global Trade		EUR			500,00
SUB-TOTAL					500,00
512 Depósitos à ordem					
BBVA - €		EUR			6 790,42
BIG - Banco de Investimento Global		EUR			171 780,67
BIG USD		USD			331,91
CGD-EUR		EUR			80 761,98
Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			47,21
DERIVADOS - Golden Broker		EUR			35 656,66
Golden Conta margem Forward USD		EUR			20 940,00
Millenium bcp		EUR			123 584,82
SUB-TOTAL					439 893,67
7 Operações com produtos derivados					
72 Fora de mercado regulamentado					
721 Forwards					
EUR/USD 22-04-2020 1.0707 BUY	1,00	EUR	5 167,37	5 167,37	5 167,37
SUB-TOTAL					5 167,37
9 Outros valores a regularizar					-5 964,45
TOTAL DE APLICAÇÕES					3 586 192,69
TOTAL DO FUNDO					3 580 228,24

Lisboa, 31 de Março de 2020