

Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Conservadora

		Valor Patrimonial Unitário em 31/07/2020			5,56231	EUR		
		N.º Unidades de Participação em circulação			1 032 939,167			
		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	96,46	593,59		61 914,62	
	SUB-TOTAL						61 914,62	
123	Obrigações diversas							
	OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	2 000,00	EUR	5,00	5,00		100,00	
	SONAE float MC 30/07/2025	100 000,00	EUR	100,00	100,00		100 000,00	
	SUB-TOTAL						100 100,00	
124	Acções							
	ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	7 160,00	EUR	5,70	5,70		40 776,20	
	SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	1 576,00	EUR	17,17	17,17		27 056,77	
	iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF USD	16 531,00	USD	5,00	5,89		70 101,44	
	SUB-TOTAL						137 934,41	
3	U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo							
31	Fundos harmonizados							
	BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 642,47	EUR	187,07	187,07		494 327,42	
	Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	740,35	EUR	152,24	152,24		112 710,88	
	CANDRIAM Euro High Yield	96,29	EUR	1 287,51	1 287,51		123 970,48	
	Candriam Long Short Global Credit	743,89	EUR	104,26	104,26		77 557,87	
	Central Fund Canada LTD	8 763,00	USD	19,67	23,17		146 306,14	
	ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	9 665,00	EUR	50,82	50,82		491 213,96	
	DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable	339,76	EUR	224,66	224,66		76 329,36	
	ETFS AGRICULTURE	5 629,00	EUR	3,04	3,04		17 089,64	
	ETFS Copper	1 339,00	EUR	22,17	22,17		29 685,63	
	FUNDSMITH Equity Fund	2 660,73	EUR	43,22	43,22		114 994,36	
	GROUPAMA Enterprises - IC	66,89	EUR	2 266,63	2 266,63		151 617,60	
	GROUPAMA Trésorerie IC	3,08	EUR	40 113,61	40 113,61		123 730,43	
	ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	1 049,00	EUR	44,79	44,79		46 984,71	
	Ishares MSCI Emerging Markets USD	1 631,00	EUR	29,60	29,60		48 269,45	
	JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	26 191,42	EUR	14,16	14,16		370 870,51	
	KEMPEN Euro Credit	156,60	EUR	1 504,65	1 504,65		235 628,19	
	Lindsell Train - CL-Equity EUR	85 636,75	EUR	1,30	1,30		111 721,70	
	M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	21 281,98	EUR	10,33	10,33		219 925,85	
	MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	586,23	EUR	142,59	142,59		83 590,54	
	MAN GLG European Inc Opportunities	1 344,04	EUR	98,21	98,21		131 998,27	
	ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	705,56	EUR	30,08	30,08		21 223,15	
	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	1 727,00	USD	24,70	29,10		36 207,18	
	Pick US iShares MSCI Global Metals & Mining Producers	2 602,00	USD	26,39	31,09		58 284,36	
	SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	6 226,00	EUR	27,54	27,54		171 464,04	
	Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	20 322,82	EUR	2,42	2,42		49 091,79	
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	6 039,00	USD	15,00	17,67		76 888,55	
	US NATURAL GAS FUND LP	1 418,00	USD	10,26	12,09		12 348,92	
	VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	537,80	EUR	124,33	124,33		66 864,67	
	Vaneck Vectors Gold Miners	1 784,00	USD	42,94	50,59		65 022,29	
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	2 806,93	EUR	108,97	108,97		305 871,16	



	iShares \$ TreasuryBond 1-3yr UCITS ETF USD (Acc) B	1 306,00	USD	114,52	134,92	126 949,18
	iShares Global Inflation Linked Govt Bond	1 683,00	EUR	151,94	151,94	255 715,02
	iShares J.P.Morgan \$EMBond EUR Hgd UCITS ETF(Dist)	1 831,00	EUR	92,10	92,10	168 635,10
	SUB-TOTAL					4 623 088,40
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	18,00	18,00	265 235,05
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	421,00	EUR	9,09	9,09	3 826,89
	SEB Immoinvest	729,00	EUR	1,40	1,40	1 022,79
	SUB-TOTAL					270 084,73
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			5 065,20
	BIG - Banco de Investimento Global	1,00	EUR	174 025,34	174 025,34	174 025,34
	BIG USD		USD			342,30
	CGD-EUR		EUR			50 626,81
	Cx. Crédito Agrícola Mútu		EUR			25,49
	DERIVADOS - Golden Broker		EUR			9 508,12
	Derivados - Broker		USD			48,81
	Golden Conta margem Forward		EUR			38 360,86
	Millenium bcp		EUR			273 211,07
	SUB-TOTAL					551 214,00
52	A prazo					
521	Depósitos e outros equiparados					
7	Operações com produtos derivados	52 000,00	EUR			0,00
71	Em mercado regulamentado					
712	Opções					
	ECU0 Long Call - 09/10/2020	6,00	USD	2 837,50	3 342,95	14 450,82
	SUB-TOTAL					14 450,82
9	Outros valores a regularizar					-13 380,32
	TOTAL DE APLICAÇÕES					5 758 911,49
	TOTAL DO FUNDO					5 745 531,17

Lisboa, 31 de Julho de 2020