

Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 30/06/2020 5,5218 EUR

N.º Unidades de Participação em circulação 1025454,2424

	Quantidade	Moeda	Cot. Moeda	Cot. Euro	Jur Dec	Valor (Euro)
1 Valores mobiliários cotados						
11 Mercado cot. ofic. de B.V. Port.						
114 Acções						
BÉS	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	96,17	590,75		61 845,65
SUB-TOTAL						61 845,65
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	6,14	6,14		43 940,92
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	1 576,00	EUR	18,61	18,61		29 326,21
iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF USD	16 531,00	USD	4,80	5,39		70 698,26
SUB-TOTAL						143 965,39
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 642,47	EUR	184,51	184,51		487 562,69
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	740,35	EUR	149,39	149,39		110 600,89
Bluebay GLB SOV OPP-M EUR	760,39	EUR	96,13	96,13		73 096,10
CANDRIAM Euro High Yield	96,29	EUR	1 258,53	1 258,53		121 180,08
Candriam Long Short Global Credit	743,89	EUR	103,26	103,26		76 813,98
Central Fund Canada LTD	8 763,00	USD	16,90	18,99		131 819,09
ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	9 665,00	EUR	51,17	51,17		494 596,71
ETF WTI CRUDE OIL (EUR)	0,00	EUR	6,21	6,21		-0,01
ETFS AGRICULTURE	5 629,00	EUR	3,07	3,07		17 264,14
ETFS Copper	1 339,00	EUR	21,94	21,94		29 370,97
FUNDSMITH Equity Fund	3 854,73	EUR	42,36	42,36		163 300,24
GROUPAMA Enterprises - IC	66,89	EUR	2 266,67	2 266,67		151 620,28
GROUPAMA Trésorerie IC	3,08	EUR	40 109,79	40 109,79		123 718,65
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	1 049,00	EUR	46,39	46,39		48 657,87
Ishares MSCI Emerging Markets USD	1 631,00	EUR	28,75	28,75		46 883,10
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	26 191,42	EUR	13,97	13,97		365 894,14
KEMPEN Euro Credit	156,60	EUR	1 481,87	1 481,87		232 060,84
Lindsell Train - GL-Equity EUR	118 440,75	EUR	1,31	1,31		155 489,01
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	21 281,98	EUR	10,15	10,15		215 918,46
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	586,23	EUR	138,04	138,04		80 923,19
MAN GLG European Inc Opportunities	1 344,04	EUR	97,38	97,38		130 882,71
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	705,56	EUR	31,76	31,76		22 408,49
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	1 727,00	USD	23,50	26,40		36 124,26
Pick US iShares MSCI Global Metals & Mining						
Producers	2 602,00	USD	24,53	27,56		56 812,47
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	6 226,00	EUR	28,26	28,26		175 940,53
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	20 322,82	EUR	2,35	2,35		47 809,42
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	6 039,00	USD	14,60	16,40		78 479,58
US NATURAL GAS FUND LP	1 418,00	USD	10,26	11,53		12 949,78
VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	537,80	EUR	119,38	119,38		64 202,56
Vaneck Vectors Gold Miners	1 784,00	USD	36,68	41,21		58 245,58

Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	2 806,93	EUR	108,14	108,14	303 541,41
iShares \$ TreasuryBond 1-3yr UCITS ETF USD (Acc) B	1 306,00	USD	114,43	128,56	133 021,51
iShares Global Inflation Linked Govt Bond	1 480,00	EUR	152,80	152,80	226 144,00
iShares J.P.Morgan \$EMBond EUR Hgd UCITS ETF(Dist)	1 831,00	EUR	89,13	89,13	163 197,03
SUB-TOTAL					4 636 529,75
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	17,95	17,95	264 462,83
SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	421,00	EUR	9,11	9,11	3 835,31
SEB Immoinvest	729,00	EUR	2,05	2,05	1 497,37
SUB-TOTAL					269 795,51
5 Liquidez					
51 À vista					
512 Depósitos à ordem					
BBVA - €		EUR			4 675,85
BIG - Banco de Investimento Global	1,00	EUR	155 916,68	155 916,68	155 916,68
BIG USD		USD			358,95
CGD-EUR		EUR			9 487,42
Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			25,49
DERIVADOS - Golden Broker		EUR			16 414,28
Golden Conta margem Forward		EUR			34 063,35
Millenium bcp		EUR			337 674,40
SUB-TOTAL					558 616,42
72 Fora de mercado regulamentado					
721 Forwards					
EUR/USD 21/07/2020 (FWD EUR/USD 21/07/2020)	1,00	EUR	8 722,40	8 722,40	8 722,40
EUR/USD 21/07/2020 (FWD EUR/USD 21/07/2020)	1,00	EUR	-3 780,76	-3 780,76	-3 780,76
SUB-TOTAL					4 941,64
9 Outros valores a regularizar					-13 545,04
TOTAL DE APLICAÇÕES					5 675 918,87
TOTAL DO FUNDO					5 662 373,83



Lisboa, 30 de Junho de 2020