

Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Equilibrada

Valor Patrimonial Unitário em 31/07/2020 8,59075 EUR
 N.º Unidades de Participação em circulação 442 964,564

	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	96,46	593,59	45 456,30
	SUB-TOTAL					45 456,30
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	5,70	5,70	37 376,29
	SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	1 956,00	EUR	17,17	17,17	33 580,61
	iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF USD	17 219,00	USD	5,00	5,89	73 018,97
	SUB-TOTAL					143 975,87
3	U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo					
31	Fundos harmonizados					
	BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	1 648,66	EUR	187,07	187,07	308 415,57
	Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	476,96	EUR	152,24	152,24	72 612,39
	CANDRIAM Euro High Yield	44,99	EUR	1 287,51	1 287,51	57 919,92
	Central Fund Canada LTD	8 035,00	USD	19,67	23,17	134 151,52
	ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	5 534,00	EUR	50,82	50,82	281 260,02
	DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable	317,40	EUR	224,66	224,66	71 307,76
	ETFS AGRICULTURE	8 600,00	EUR	3,04	3,04	26 109,60
	ETFS Copper	1 607,00	EUR	22,17	22,17	35 627,19
	FUNDSMITH Equity Fund	2 541,88	EUR	43,22	43,22	109 857,77
	ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	749,00	EUR	44,79	44,79	33 547,71
	Ishares MSCI Emerging Markets USD	1 971,00	EUR	29,60	29,60	58 331,75
	JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	11 128,53	EUR	14,16	14,16	157 579,98
	Jupiter Dynamic Bond Fund	6 090,00	EUR	11,01	11,01	67 050,90
	KEMPEN Euro Credit	55,12	EUR	1 504,65	1 504,65	82 936,31
	Lindsell Train - GL-Equity EUR	81 592,33	EUR	1,30	1,30	106 445,35
	M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	7 807,10	EUR	10,33	10,33	80 677,76
	MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	368,10	EUR	142,59	142,59	52 487,09
	MAN GLG European Inc Opportunities	918,56	EUR	98,21	98,21	90 211,68
	ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	935,61	EUR	30,08	30,08	28 143,09
	PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	2 340,00	USD	24,70	29,10	49 058,94
	Pick US iShares MSCI Global Metals & Mining Producers	3 211,00	USD	26,39	31,09	71 925,86
	SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	4 097,00	EUR	27,54	27,54	112 831,38
	Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	25 151,97	EUR	2,42	2,42	60 757,10
	THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	4 748,00	USD	15,00	17,67	60 451,54
	US NATURAL GAS FUND LP	1 749,00	USD	10,26	12,09	15 231,50
	VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	495,80	EUR	124,33	124,33	61 642,81
	Vaneck Vectors Gold Miners	2 168,00	USD	42,94	50,59	79 018,12



	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 259,64	EUR	108,97	108,97	137 262,86
	iShares Global Inflation Linked Govt Bond	1 111,00	EUR	151,94	151,94	168 805,34
	iShares J.P.Morgan \$EMBond EUR Hgd UCITS ETF(Dist)	1 051,00	EUR	92,10	92,10	96 797,10
	SUB-TOTAL					2 768 455,91
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	18,00	18,00	143 659,24
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	1 485,00	EUR	9,09	9,09	13 498,65
	SEB Immoinvest	1 847,00	EUR	1,40	1,40	2 591,34
	SUB-TOTAL					159 749,23
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			6 310,62
	BIG - Banco de Investimento Global		EUR			252 662,57
	BIG USD		USD			509,44
	CGD-EUR		EUR			46 112,31
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			47,21
	DERIVADOS - Golden Broker		EUR			29 872,75
	Derivados - Broker		USD			68,96
	Golden Conta margem Forward		EUR			26 267,28
	Millenium bcp		EUR			314 756,28
	SUB-TOTAL					676 607,42
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	5,00	USD	2 837,50	3 342,95	12 042,35
	SUB-TOTAL					12 042,35
9	Outros valores a regularizar					-11 659,87
	TOTAL DE APLICAÇÕES					3 817 056,76
	TOTAL DO FUNDO					3 805 396,89

Lisboa, 31 de Julho de 2020