

Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Garantida

Valor Patrimonial Unitário em 30/06/2020 4,8403 EUR
N.º Unidades de Participação em circulação 413 882,2649

| | Quantidade | Moeda | Cot. Moeda | Cot. Euro | Jur Dec | Valor (Euro) |
|---|------------|-------|------------|-----------|---------|---------------------|
| 1 Valores mobiliários cotados | | | | | | |
| 11 Mercado cot. ofic. de B.V. Port. | | | | | | |
| 111 Títulos de dívida pública | | | | | | |
| BTPS 1.35 04/01/30 | 30 000,00 | EUR | 101,28 | 101,28 | 99,86 | 30 483,56 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 30 483,56 |
| 12 Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE | | | | | | |
| 122 Outros fundos públicos e equiparados | | | | | | |
| EIB 0% 27/08/2021 BRL | 35 000,00 | BRL | 96,17 | 590,75 | | 5 479,99 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 5 479,99 |
| 124 Acções | | | | | | |
| ISHARES Eurostoxx Banks 30-15 | 1 659,00 | EUR | 6,14 | 6,14 | | 10 181,28 |
| iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF | | | | | | |
| USD | 2 066,00 | USD | 4,80 | 5,39 | | 8 835,68 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 19 016,96 |
| 3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo | | | | | | |
| 31 Fundos harmonizados | | | | | | |
| Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return | 235,00 | EUR | 149,39 | 149,39 | | 35 106,65 |
| BlueBay Inv Grade Euro Govt Bd M EUR | 1 081,61 | EUR | 141,77 | 141,77 | | 153 339,85 |
| Bluebay GLB SOV OPP-M EUR | 132,77 | EUR | 96,13 | 96,13 | | 12 763,18 |
| CANDRIAM Euro High Yield | 39,84 | EUR | 1 258,53 | 1 258,53 | | 50 139,84 |
| Candriam Long Short Global Credit | 186,00 | EUR | 103,26 | 103,26 | | 19 206,36 |
| ComStage Bund-Future Short UCITS ETF | 2 861,00 | EUR | 51,17 | 51,17 | | 146 408,81 |
| FUNDSMITH Equity Fund | 483,91 | EUR | 42,36 | 42,36 | | 20 500,17 |
| GOLD(ISHARES PH.MET.)-ETC-11/PERP S | 270,00 | EUR | 31,02 | 31,02 | | 8 375,40 |
| ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED | 212,00 | EUR | 46,39 | 46,39 | | 9 833,62 |
| JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY | 7 691,63 | EUR | 13,97 | 13,97 | | 107 452,07 |
| KEMPEN Euro Credit | 65,83 | EUR | 1 481,87 | 1 481,87 | | 97 551,50 |
| LYXOR ETF EuroMTS 1-3 Y | 360,00 | EUR | 124,64 | 124,64 | | 44 870,40 |
| Lindsell Train - GL-Equity EUR | 15 229,91 | EUR | 1,31 | 1,31 | | 19 993,83 |
| M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC | 9 821,26 | EUR | 10,15 | 10,15 | | 99 642,58 |
| MAN AHL Trend Alternative IN HEUR | 198,00 | EUR | 138,04 | 138,04 | | 27 331,92 |
| MAN GLG European Inc Opportunities | 452,96 | EUR | 97,38 | 97,38 | | 44 109,24 |
| SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF | 2 126,00 | EUR | 28,26 | 28,26 | | 60 078,63 |
| THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS | 1 522,00 | USD | 14,60 | 16,40 | | 19 779,09 |
| VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I) | 169,60 | EUR | 119,38 | 119,38 | | 20 246,85 |
| Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund | 1 053,96 | EUR | 108,14 | 108,14 | | 113 975,23 |
| iShares \$ Short Dur Corp Bd USD | 793,00 | USD | 104,51 | 117,41 | | 73 768,31 |
| iShares Global Inflation Linked Govt Bond | 546,00 | EUR | 152,80 | 152,80 | | 83 428,80 |
| iShares J.P.Morgan \$EMBond EUR Hgd UCITS ETF(Dist) | 473,00 | EUR | 89,13 | 89,13 | | 42 158,49 |
| iShares Physical Silver ETC | 595,00 | USD | 17,54 | 19,71 | | 9 288,03 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 1 319 348,85 |
| 4 Imobiliário | | | | | | |
| 42 U. P.'s de fundos de investimento imobiliário | | | | | | |
| CA Património Crescente | 2 374,00 | EUR | 17,95 | 17,95 | | 42 602,62 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 42 602,62 |
| 5 Liquidez | | | | | | |



| | | | |
|------------|-------------------------------------|-----|---------------------|
| 51 | À vista | | |
| | BIG Global Trade | EUR | 500,00 |
| | SUB-TOTAL | | 500,00 |
| 512 | Depósitos à ordem | | |
| | BIG - Banco de Investimento Global | EUR | 586 930,30 |
| | BIG USD | USD | 1 750,15 |
| | SUB-TOTAL | | 588 680,45 |
| 9 | Outros valores a regularizar | | -2 792,76 |
| | TOTAL DE APLICAÇÕES | | 2 006 112,43 |
| | TOTAL DO FUNDO | | 2 003 319,67 |

Lisboa, 30 de Junho de 2020