

Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 31/08/2020 5,60292 EUR
 N.º Unidades de Participação em circulação 1 043 595,74523

	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	96,62	633,60		58 203,88
SUB-TOTAL						58 203,88
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	102,33	102,33	80,92	102 408,92
SUB-TOTAL						102 508,92
124 Acções						
ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	7 160,00	EUR	6,03	6,03		43 160,48
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	1 576,00	EUR	17,39	17,39		27 403,49
iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF						
USD	16 531,00	USD	5,30	6,33		73 346,03
SUB-TOTAL						143 910,00
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 642,47	EUR	185,82	185,82		491 024,33
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	740,35	EUR	152,23	152,23		112 703,48
CANDRIAM Euro High Yield	96,29	EUR	1 301,68	1 301,68		125 334,86
Candriam Long Short Global Credit	743,89	EUR	104,33	104,33		77 609,94
Central Fund Canada LTD	8 763,00	USD	20,52	24,50		150 632,50
ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	9 665,00	EUR	51,35	51,35		496 317,08
DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable	339,76	EUR	236,56	236,56		80 372,44
ETFS AGRICULTURE	5 629,00	EUR	3,17	3,17		17 858,00
ETFS Copper	1 339,00	EUR	22,97	22,97		30 756,83
FUNDSMITH Equity Fund	2 660,73	EUR	45,27	45,27		120 442,47
GROUPAMA Enterprises - IC	66,89	EUR	2 266,36	2 266,36		151 599,54
GROUPAMA Trésorerie IC	3,08	EUR	40 112,19	40 112,19		123 726,05
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	1 049,00	EUR	47,52	47,52		49 843,24
Ishares MSCI Emerging Markets USD	1 631,00	EUR	30,07	30,07		49 036,02
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	26 191,42	EUR	14,13	14,13		370 084,76
KEMPEN Euro Credit	156,60	EUR	1 506,22	1 506,22		235 874,05
Lindsell Train - GL-Equity EUR	85 636,75	EUR	1,34	1,34		115 155,73
M&G OPTIMAL INCOME C EUR ACC	21 281,98	EUR	10,35	10,35		220 330,21
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	586,23	EUR	141,29	141,29		82 828,44
MAN GLG European Inc Opportunities	1 344,04	EUR	101,51	101,51		136 433,60
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	705,56	EUR	33,09	33,09		23 346,88
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	1 727,00	USD	27,85	33,25		40 290,82
Pick US iShares MSCI Global Metals & Mining Producers	2 602,00	USD	27,81	33,20		60 617,33
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	6 226,00	EUR	27,19	27,19		169 272,49
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	20 322,82	EUR	2,45	2,45		49 717,73
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	6 039,00	USD	16,03	19,14		81 068,40
VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	537,80	EUR	126,37	126,37		67 961,79
Vaneck Vectors Gold Miners	1 784,00	USD	42,27	50,46		63 170,69



	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	2 806,93	EUR	109,34	109,34	306 909,73
	iShares \$ TreasuryBond 1-3yr UCITS ETF USD (Acc) B	1 306,00	USD	114,49	136,67	125 256,20
	iShares Global Inflation Linked Govt Bond iShares J.P.Morgan \$EMBond EUR Hgd UCITS ETF(Dist)	1 683,00	EUR	149,99	149,99	252 433,17
		1 831,00	EUR	92,46	92,46	169 285,11
	SUB-TOTAL					4 647 293,91
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	18,03	18,03	265 739,06
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	421,00	EUR	9,08	9,08	3 822,68
	SEB Immoinvest	729,00	EUR	1,47	1,47	1 074,55
	SUB-TOTAL					270 636,29
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			5 013,20
	BIG - Banco de Investimento Global	1,00	EUR	190 897,49	190 897,49	190 897,49
	BIG USD		USD			337,82
	CGD-EUR		EUR			114 862,76
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			25,49
	DERIVADOS - Golden Broker		EUR			9 508,12
	Derivados - Broker		USD			48,17
	Golden Conta margem Forward		EUR			38 360,86
	Millenium bcp		EUR			255 934,67
	SUB-TOTAL					614 988,58
7	Operações com produtos derivados					
71	Em mercado regulamentado					
712	Opções					
	ECUO Long Call - 09/10/2020	6,00	USD	3 650,00	4 357,17	18 345,63
	SUB-TOTAL					18 345,63
9	Outros valores a regularizar					-8 825,16
	TOTAL DE APLICAÇÕES					5 856 011,72
	TOTAL DO FUNDO					5 847 186,56

Lisboa, 31 de Agosto de 2020