

## Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Equilibrada

Valor Patrimonial Unitário em 30/09/2020 8,59099 EUR  
 N.º Unidades de Participação em circulação 442 361,7666

	Quantidade	Moeda	Cot. Moeda	Cot. Euro	Jur Dec	Valor (Euro)
<b>1 Valores mobiliários cotados</b>						
<b>11 Mercado cot. ofic. de B.V. Port.</b>						
<b>114 Acções</b>						
BES	123 532,00	EUR				0,00
<b>12 Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE</b>						
<b>122 Outros fundos públicos e equiparados</b>						
EIB 0% 27/08/2021 BRL	620 000,00	BRL	96,85	637,16		91 269,56
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>91 269,56</b>
<b>123 Obrigações diversas</b>						
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
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>810,00</b>
<b>124 Acções</b>						
ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	6 563,00	EUR	5,30	5,30		34 797,03
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	1 956,00	EUR	15,29	15,29		29 915,06
iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF USD	17 219,00	USD	5,21	6,11		76 459,00
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>141 171,09</b>
<b>3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo</b>						
<b>31 Fundos harmonizados</b>						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	1 648,66	EUR	188,34	188,34		310 509,38
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	476,96	EUR	155,69	155,69		74 257,90
CANDRIAM Euro High Yield	74,51	EUR	1 288,14	1 288,14		95 976,74
Central Fund Canada LTD	8 035,00	USD	18,34	21,50		125 714,44
ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	5 534,00	EUR	50,78	50,78		281 016,52
DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable	317,40	EUR	232,56	232,56		73 815,24
ETFS AGRICULTURE	8 600,00	EUR	3,26	3,26		28 066,10
ETFS Copper	1 607,00	EUR	23,22	23,22		37 314,54
FUNDSMITH Equity Fund	2 541,88	EUR	44,88	44,88		114 084,91
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	749,00	EUR	48,56	48,56		36 371,44
Ishares MSCI Emerging Markets USD	1 971,00	EUR	30,39	30,39		59 898,69
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	11 128,53	EUR	14,16	14,16		157 579,98
Jupiter Dynamic Bond Fund	6 090,00	EUR	10,90	10,90		66 381,00
KEMPEN Euro Credit	76,31	EUR	1 507,12	1 507,12		115 008,33
Lindsell Train - GL-Equity EUR	81 592,33	EUR	1,34	1,34		109 039,99
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	368,10	EUR	138,32	138,32		50 915,32
MAN GLG European Inc Opportunities	918,56	EUR	98,34	98,34		90 331,09
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	935,61	EUR	32,67	32,67		30 566,32
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	3 294,00	USD	27,35	32,06		76 856,55
Pick US iShares MSCI Global Metals & Mining Producers	3 211,00	USD	26,78	31,39		73 358,56
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	4 241,00	EUR	27,30	27,30		115 787,78
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	25 151,97	EUR	2,53	2,53		63 694,85
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	4 748,00	USD	17,15	20,10		69 466,40



	VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I)	495,80	EUR	122,04	122,04	60 507,43
	Vaneck Vectors Gold Miners	2 168,00	USD	39,16	45,90	72 427,23
	Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 259,64	EUR	109,35	109,35	137 741,52
	iShares Global Inflation Linked Govt Bond	1 111,00	EUR	151,18	151,18	167 960,98
	iShares J.P.Morgan \$EMBond EUR Hgd UCITS ETF(Dist)	1 051,00	EUR	90,40	90,40	95 010,40
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>2 789 659,63</b>
<b>32</b>	<b>Fundos não harmonizados</b>					
	BANIF Global Private Equity Fund - FCR	53 325,91	EUR	0,19	0,19	9 959,68
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>9 959,68</b>
<b>4</b>	<b>Imobiliário</b>					
<b>42</b>	<b>U. P.'s de fundos de investimento imobiliário</b>					
	CA Património Crescente	7 982,00	EUR	18,08	18,08	144 312,96
	SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN	1 485,00	EUR	9,07	9,07	13 468,95
	SEB Immoinvest	1 847,00	EUR	1,49	1,49	2 742,80
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>160 524,71</b>
<b>5</b>	<b>Liquidez</b>					
<b>51</b>	<b>À vista</b>					
<b>512</b>	<b>Depósitos à ordem</b>					
	BBVA - €		EUR			5 318,03
	BBVA-USD		USD			-20 594,72
	BIG - Banco de Investimento Global		EUR			96 081,40
	BIG USD		USD			21 306,37
	CGD-EUR		EUR			41 843,44
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			47,21
	DERIVADOS - Golden Broker		EUR			48 505,16
	Derivados - Broker		USD			69,31
	Golden Conta margem Forward		EUR			26 267,28
	Millenium USD		USD			-21 385,65
	Millenium bcp		EUR			412 058,88
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>609 516,71</b>
<b>7</b>	<b>Operações com produtos derivados</b>					
<b>71</b>	<b>Em mercado regulamentado</b>					
<b>712</b>	<b>Opções</b>					
	ECU0 Long Call - 09/10/2020	5,00	USD	837,50	981,71	3 572,36
	<b>SUB-TOTAL</b>					<b>3 572,36</b>
<b>9</b>	<b>Outros valores a regularizar</b>					<b>-6 158,64</b>
	<b>TOTAL DE APLICAÇÕES</b>					<b>3 806 483,74</b>
	<b>TOTAL DO FUNDO</b>					<b>3 800 325,10</b>

Lisboa, 30 de Setembro de 2020