

## Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Garantida

Valor Patrimonial Unitário em 30/09/2020 4,85545 EUR  
N.º Unidades de Participação em circulação 502 933,1543

	Quantidade	Moeda	Cot. Moeda	Cot. Euro	Jur Dec	Valor (Euro)
<b>1 Valores mobiliários cotados</b>						
<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	310 000,00	BRL	96,85	637,16		45 634,78
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>45 634,78</b>
<b>123 Obrigações diversas</b>						
SONAE float MC 30/07/2025	100 000,00	EUR	101,87	101,87	161,83	102 026,83
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>102 026,83</b>
<b>124 Acções</b>						
ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	1 659,00	EUR	5,30	5,30		8 796,02
iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF USD	2 066,00	USD	5,21	6,11		9 173,84
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>17 969,86</b>
<b>3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo</b>						
<b>31 Fundos harmonizados</b>						
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	315,00	EUR	155,69	155,69		49 042,35
BlueBay Inv Grade Euro Govt Bd M EUR	1 420,61	EUR	144,70	144,70		205 562,27
CANDRIAM Euro High Yield	65,84	EUR	1 288,14	1 288,14		84 811,14
Candriam Long Short Global Credit	186,00	EUR	104,23	104,23		19 386,78
ComStage Bund-Future Short UCITS ETF	3 799,00	EUR	50,78	50,78		192 913,22
DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable	66,00	EUR	232,56	232,56		15 348,96
FUNDSMITH Equity Fund	391,91	EUR	44,88	44,88		17 589,74
GOLD(ISHARES PH.MET.)-ETC-11/PERP S	270,00	EUR	31,63	31,63		8 538,75
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	212,00	EUR	48,56	48,56		10 294,72
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	9 552,63	EUR	14,16	14,16		135 265,24
KEMPEN Euro Credit	113,83	EUR	1 507,12	1 507,12		171 555,47
LYXOR ETF EuroMTS 1-3 Y	360,00	EUR	124,76	124,76		44 913,60
Lindsell Train - GL-Equity EUR	12 247,91	EUR	1,34	1,34		16 368,11
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	270,00	EUR	138,32	138,32		37 346,40
MAN GLG European Inc Opportunities	452,96	EUR	98,34	98,34		44 544,09
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	1 040,00	USD	27,35	32,06		24 265,58
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	3 594,00	EUR	27,30	27,30		98 123,39
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	1 522,00	USD	17,15	20,10		22 267,87
VONTOBEL-MTX SUST.EM.MKTS LEAD(I) Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit	169,60	EUR	122,04	122,04		20 697,98
Fund	1 349,96	EUR	109,35	109,35		147 618,13
iShares \$ Short Dur Corp Bd USD	1 055,00	USD	104,38	122,35		93 939,64
iShares Global Inflation Linked Govt Bond	894,00	EUR	151,18	151,18		135 154,92
iShares J.P.Morgan \$EMBond EUR Hgd UCITS ETF(Dist)	821,00	EUR	90,40	90,40		74 218,40
iShares Physical Silver ETC	595,00	USD	23,05	27,02		11 700,69
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>1 681 467,44</b>
<b>4 Imobiliário</b>						
<b>42 U. P.'s de fundos de investimento imobiliário</b>						
CA Património Crescente	2 374,00	EUR	18,08	18,08		42 921,45
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>42 921,45</b>
<b>5 Liquidez</b>						



<b>51</b>	<b>À vista</b>		
	BIG Global Trade	EUR	500,00
	<b>SUB-TOTAL</b>		<b>500,00</b>
<b>512</b>	<b>Depósitos à ordem</b>		
	BIG - Banco de Investimento Global	EUR	515 130,00
	BIG USD	USD	1 616,80
	DERIVADOS - Golden Broker	EUR	38 421,61
	<b>SUB-TOTAL</b>		<b>555 168,41</b>
<b>9</b>	<b>Outros valores a regularizar</b>		<b>-3 723,63</b>
	<b>TOTAL DE APLICAÇÕES</b>		<b>2 445 688,77</b>
	<b>TOTAL DO FUNDO</b>		<b>2 441 965,14</b>

Lisboa, 30 de Setembro de 2020