

Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 30/06/2021 5,88190 EUR
 N.º Unidades de Participação em circulação 958 452,5055

	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	850 000,00	BRL	99,20	584,56		143 089,60
SUB-TOTAL						143 089,60
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	101,08	101,08	345,60	101 421,60
SUB-TOTAL						101 521,60
124 Acções						
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	4 170,00	EUR	25,20	25,20		105 084,00
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)	716,00	EUR	140,24	140,24		100 411,84
iShares Edge MSCI EM Value	1 485,00	EUR	40,06	40,06		59 489,10
iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF USD	11 431,00	USD	7,34	8,70		70 741,40
SUB-TOTAL						335 726,34
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
AMUNDI MSCI EM ASIA UCITS ETF	3 146,00	EUR	39,84	39,84		125 320,91
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	1 338,33	EUR	185,90	185,90		248 796,10
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	1 483,17	EUR	152,98	152,98		226 895,35
CANDRIAM Euro High Yield	134,36	EUR	1 376,21	1 376,21		184 900,69
Candriam Long Short Global Credit	829,95	EUR	105,74	105,74		87 758,60
Central Fund Canada LTD	8 763,00	USD	18,68	22,15		138 042,17
DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable	260,76	EUR	292,62	292,62		76 302,13
FUNDSMITH Equity Fund	2 041,73	EUR	55,42	55,42		113 152,68
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	21 556,42	EUR	14,46	14,46		311 705,83
KEMPEN Euro Credit	229,82	EUR	1 533,44	1 533,44		352 415,18
LYXOR BUND FUTURE DAILY(-1X) INVERSE UCITS ETF	8 811,00	EUR	51,15	51,15		450 717,89
Lindsell Train - GL-Equity EUR	70 384,75	EUR	1,59	1,59		111 911,74
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	586,23	EUR	153,84	153,84		90 185,62
MAN GLG European Inc Opportunities	970,04	EUR	119,06	119,06		115 493,08
Nordea 1 Low Duration European Covered Bond BI ETF	1 096,79	EUR	103,89	103,89		113 945,10
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	2 120,88	EUR	41,64	41,64		88 313,50
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	3 765,00	USD	36,45	43,22		115 729,64
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	8 301,00	EUR	28,19	28,19		234 038,39
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	20 322,82	EUR	3,14	3,14		63 813,64
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	6 039,00	USD	27,00	32,02		137 502,59
Vaneck Vectors Gold Miners UCITS ETF	2 461,00	EUR	30,33	30,33		74 629,83
Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 581,51	EUR	111,34	111,34		176 085,32
iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist	63 788,00	EUR	4,58	4,58		292 072,49
iShares Global Inflation Linked Govt Bond	2 112,00	EUR	155,65	155,65		328 732,80
iShares J.P.Morgan \$EMBond EUR Hgd UCITS ETF(Dist)	1 831,00	EUR	90,96	90,96		166 538,61
SUB-TOTAL						4 424 999,88
32 Fundos não harmonizados						



	BANIF Global Private Equity Fund - FCR	666,67	EUR	0,19	0,19	124,51
	INDICO ACCELERATION SUB-FUND I GENERAL	32 984,12	EUR	0,61	0,61	20 006,53
	SUB-TOTAL					20 131,04
4	Imobiliário					
42	U. P.'s de fundos de investimento imobiliário					
	CA Património Crescente	14 737,00	EUR	18,59	18,59	273 960,83
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	421,00	EUR	6,37	6,37	2 681,77
	SEB Immoinvest	729,00	EUR	1,19	1,19	867,51
	SUB-TOTAL					277 510,11
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			422,00
	BIG - Banco de Investimento Global		EUR			54 546,29
	BIG USD		USD			-51 909,57
	CGD-EUR		EUR			42 470,82
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			125,49
	GOLDEN CC EURO		EUR			585,94
	GOLDEN CONTA MARGEM EURO		EUR			24 292,82
	GOLDEN CONTA MARGEM USD		USD			4 366,18
	GOLDEN FUTURO		USD			-8 011,35
	GOLDEN INDICO		EUR			8 617,02
	Millenium USD		USD			51 909,57
	Millenium bcp		EUR			205 424,46
	SUB-TOTAL					332 839,67
7	Operações com produtos derivados					
71	Em mercado regulamentado					
711	Futuros					
	E-mini EURUSD - Set 2021	4,00	USD	1,19	1,41	0,00
712	Opções					
	Put SPY US 10/15/21 P400	18,00	USD	702,00	832,44	10 655,94
	SUB-TOTAL					10 655,94
9	Outros valores a regularizar					-8 954,77
	TOTAL DE APLICAÇÕES					5 646 474,18
	TOTAL DO FUNDO					5 637 519,41

Lisboa, 30 de Junho de 2021