

Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 31/05/2021 5,84334 EUR
 N.º Unidades de Participação em circulação 959 291,2268

	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	98,90	631,11		131 723,20
SUB-TOTAL						131 723,20
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	101,23	101,23	276,01	101 506,01
SUB-TOTAL						101 606,01
124 Acções						
ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	7 160,00	EUR	9,62	9,62		68 843,40
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	4 170,00	EUR	23,85	23,85		99 433,65
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)	716,00	EUR	139,40	139,40		99 810,40
iShares Edge MSCI EM Value	1 485,00	EUR	39,64	39,64		58 857,98
iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF USD	16 531,00	USD	7,34	8,98		99 150,12
SUB-TOTAL						426 095,55
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
AMUNDI MSCI EM ASIA UCITS ETF	3 146,00	EUR	38,55	38,55		121 272,01
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	1 397,33	EUR	185,66	185,66		259 428,84
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	1 483,17	EUR	150,41	150,41		223 083,60
CANDRIAM Euro High Yield	134,36	EUR	1 368,90	1 368,90		183 918,56
Candriam Long Short Global Credit	829,95	EUR	105,56	105,56		87 609,21
Central Fund Canada LTD	8 763,00	USD	20,15	24,64		144 384,93
DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable	339,76	EUR	273,47	273,47		92 912,80
FUNDSMITH Equity Fund	2 660,73	EUR	52,35	52,35		139 292,67
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	26 191,42	EUR	14,27	14,27		373 751,56
KEMPEN Euro Credit	229,82	EUR	1 529,14	1 529,14		351 426,95
LYXOR BUND FUTURE DAILY(-1X) INVERSE UCITS ETF	8 811,00	EUR	51,54	51,54		454 118,94
Lindsell Train - GL-Equity EUR	85 636,75	EUR	1,53	1,53		131 135,55
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	586,23	EUR	155,42	155,42		91 111,87
MAN GLG European Inc Opportunities	1 091,04	EUR	116,70	116,70		127 324,48
Nordea 1 Low Duration European Covered Bond BI EUR	1 096,79	EUR	104,02	104,02		114 087,68
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	2 120,88	EUR	40,68	40,68		86 277,46
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	3 765,00	USD	38,40	46,96		118 219,80
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	8 301,00	EUR	27,60	27,60		229 140,80
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	20 322,82	EUR	3,05	3,05		61 937,84
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	6 039,00	USD	26,00	31,80		128 390,35
Vaneck Vectors Gold Miners	1 784,00	USD	39,42	48,21		57 504,98
Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 581,51	EUR	111,09	111,09		175 689,95
iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist	63 788,00	EUR	4,57	4,57		291 421,86
iShares Global Inflation Linked Govt Bond	2 112,00	EUR	152,93	152,93		322 988,16
iShares J.P.Morgan \$EMBond EUR Hgd UCITS ETF(Dist)	1 831,00	EUR	90,59	90,59		165 870,29



4 532 301,14

SUB-TOTAL							4 532 301,14
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	18,50	18,50	272 689,03	
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	421,00	EUR	6,38	6,38	2 685,98	
	SEB Immoinvest	729,00	EUR	1,17	1,17	849,29	
SUB-TOTAL							276 224,30
5	Liquidez						
51	À vista						
512	Depósitos à ordem						
	BBVA - €		EUR			448,00	
	BIG - Banco de Investimento Global	1,00	EUR	4 637,14	4 637,14	4 637,14	
	CGD-EUR		EUR			41 532,92	
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			125,49	
	GOLDEN CC EURO		EUR			585,94	
	GOLDEN CONTA MARGEM EURO		EUR			24 338,24	
	GOLDEN CONTA MARGEM USD		USD			4 233,63	
	GOLDEN FUTURO		USD			-306,64	
	GOLDEN INDICO		EUR			8 632,76	
	Millenium bcp		EUR			26 029,84	
SUB-TOTAL							110 257,32
7	Operações com produtos derivados						
71	Em mercado regulamentado						
711	Futuros						
	E-mini EURUSD - Jun 21	4,00	USD	1,22	1,49	0,00	
712	Opções						
	Put SPY US 10/15/21 P400	18,00	USD	1 100,00	1 345,24	16 190,46	
SUB-TOTAL							16 190,46
9	Outros valores a regularizar					-9 067,67	
TOTAL DE APLICAÇÕES							5 614 529,02
TOTAL DO FUNDO							5 605 461,35

Lisboa, 31 de Maio de 2021