

Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Equilibrada

Valor Patrimonial Unitário em 31/05/2021 9,22307 EUR
 N.º Unidades de Participação em circulação 504 140,99378

	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	123 532,00	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	620 000,00	BRL	98,90	631,11		96 080,45
SUB-TOTAL						96 080,45
123 Obrigações diversas						
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
SUB-TOTAL						810,00
124 Acções						
ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	6 563,00	EUR	9,62	9,62		63 103,25
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	3 937,00	EUR	23,85	23,85		93 877,77
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)	667,00	EUR	139,40	139,40		92 979,80
iShares Edge MSCI EM Value	2 110,00	EUR	39,64	39,64		83 629,85
iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF USD	17 219,00	USD	7,34	8,98		103 276,63
SUB-TOTAL						436 867,30
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
AMUNDI MSCI EM ASIA UCITS ETF	2 191,00	EUR	38,55	38,55		84 458,67
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	879,89	EUR	185,66	185,66		163 361,12
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	976,44	EUR	150,41	150,41		146 866,34
CANDRIAM Euro High Yield	74,51	EUR	1 368,90	1 368,90		101 994,00
Central Fund Canada LTD	12 502,00	USD	20,15	24,64		205 991,14
DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable	337,67	EUR	273,47	273,47		92 342,89
FUNDSMITH Equity Fund	2 541,88	EUR	52,35	52,35		133 070,72
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	11 128,53	EUR	14,27	14,27		158 804,12
Jupiter Dynamic Bond Fund	6 090,00	EUR	10,77	10,77		65 589,30
KEMPEN Euro Credit	125,59	EUR	1 529,14	1 529,14		192 044,69
LYXOR BUND FUTURE DAILY(-1X) INVERSE UCITS ETF	6 718,00	EUR	51,54	51,54		346 245,72
Lindsell Train - GL-Equity EUR	83 427,88	EUR	1,53	1,53		127 753,12
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	368,10	EUR	155,42	155,42		57 209,79
MAN GLG European Inc Opportunities	940,22	EUR	116,70	116,70		109 723,91
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	1 984,90	EUR	40,68	40,68		80 745,75
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	3 294,00	USD	38,40	46,96		103 430,55
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	6 716,00	EUR	27,60	27,60		185 388,46
Steward Investors Asia Pacific Leaders Fund	27 336,17	EUR	3,05	3,05		83 312,45
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	4 748,00	USD	26,00	31,80		100 943,43
Vaneck Vectors Gold Miners	2 168,00	USD	39,42	48,21		69 882,74
iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist	50 886,00	EUR	4,57	4,57		232 477,78
iShares Global Inflation Linked Govt Bond	1 527,00	EUR	152,93	152,93		233 524,11
iShares J.P.Morgan \$EMBond EUR Hgd UCITS ETF(Dist)	1 051,00	EUR	90,59	90,59		95 210,09
SUB-TOTAL						3 170 370,89
32 Fundos não harmonizados						



	BANIF Global Private Equity Fund - FCR	53 325,91	EUR	0,19	0,19	9 959,68
	INDICO ACCELERATION SUB-FUND I GENERAL	21 700,12	EUR	0,61	0,61	13 162,20
	SUB-TOTAL					23 121,88
4	Imobiliário					
42	U. P.'s de fundos de investimento imobiliário					
	CA Património Crescente	7 982,00	EUR	18,50	18,50	147 696,53
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	1 485,00	EUR	6,38	6,38	9 474,30
	SEB Immoinvest	1 847,00	EUR	1,17	1,17	2 151,76
	SUB-TOTAL					159 322,59
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			448,00
	BIG - Banco de Investimento Global		EUR			7 316,70
	CGD-EUR		EUR			369 225,50
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			147,21
	GOLDEN CC EURO		EUR			9 590,46
	GOLDEN CONTA MARGEM EURO		EUR			26 244,66
	GOLDEN CONTA MARGEM USD		USD			3 528,03
	GOLDEN FUTURO		USD			-306,64
	GOLDEN INDICO		EUR			5 713,64
	Millenium bcp		EUR			480 687,26
	SUB-TOTAL					902 594,82
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	16,00	USD	1 100,00	1 345,24	14 391,52
	SUB-TOTAL					14 391,52
9	Outros valores a regularizar					-153 831,25
	TOTAL DE APLICAÇÕES					4 803 559,45
	TOTAL DO FUNDO					4 649 728,20

Lisboa, 31 de Maio de 2021