

Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Garantida

 Valor Patrimonial Unitário em 31/05/2021 4,97530 EUR
 N.º Unidades de Participação em circulação 508 041,2495

	Quantidade	Moeda	Cot. Moeda	Cot. Euro	Jur Dec	Valor (Euro)
1 Valores mobiliários cotados						
12 Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE						
122 Outros fundos públicos e equiparados						
EIB 0% 27/08/2021 BRL	310 000,00	BRL	98,89	631,11		48 040,22
SUB-TOTAL						48 040,22
123 Obrigações diversas						
SONAE float MC 30/07/2025	100 000,00	EUR	101,23	101,23	276,01	101 506,01
SUB-TOTAL						101 506,01
124 Acções						
ISHARES Eurostoxx Banks 30-15	1 659,00	EUR	9,62	9,62		15 951,29
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	1 274,00	EUR	23,85	23,85		30 378,53
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)	206,00	EUR	139,40	139,40		28 716,40
iShares MSCI World Small Cap UCITS ETF USD	2 066,00	USD	7,34	8,98		12 391,52
SUB-TOTAL						87 437,74
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
AMUNDI MSCI EM ASIA UCITS ETF	1 124,00	EUR	38,55	38,55		43 327,95
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	741,00	EUR	150,41	150,41		111 453,81
BlueBay Inv Grade Euro Govt Bd M EUR	970,61	EUR	142,61	142,61		138 418,69
CANDRIAM Euro High Yield	65,84	EUR	1 368,90	1 368,90		90 128,38
Candriam Long Short Global Credit	703,00	EUR	105,56	105,56		74 208,68
DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable	66,00	EUR	273,47	273,47		18 049,02
FUNDSMITH Equity Fund	391,91	EUR	52,35	52,35		20 517,00
GOLD(ISHARES PH.MET.)-ETC-11/PERP S	1 621,00	EUR	30,34	30,34		49 173,04
ISHARES MSCI JPN EUR HEDGED	483,00	EUR	58,62	58,62		28 311,05
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	9 552,63	EUR	14,27	14,27		136 316,03
KEMPEN Euro Credit	113,83	EUR	1 529,14	1 529,14		174 062,01
LYXOR BUND FUTURE DAILY(-1X) INVERSE UCITS						
ETF	3 799,00	EUR	51,54	51,54		195 800,46
Lindsell Train - GL-Equity EUR	12 247,91	EUR	1,53	1,53		18 755,22
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	270,00	EUR	155,42	155,42		41 963,40
MAN GLG European Inc Opportunities	386,96	EUR	116,70	116,70		45 158,23
Nordea 1 Low Duration European Covered Bond BI						
EUR	1 050,00	EUR	104,02	104,02		109 221,00
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	1 040,00	USD	38,40	46,96		32 655,67
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	3 982,00	EUR	27,60	27,60		109 919,13
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	1 522,00	USD	26,00	31,80		32 358,02
Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 349,96	EUR	111,09	111,09		149 967,06
iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist	30 600,00	EUR	4,57	4,57		139 799,16
iShares Global Inflation Linked Govt Bond	999,00	EUR	152,93	152,93		152 777,07
iShares J.P.Morgan \$EMBond EUR Hgd UCITS						
ETF(Dist)	908,00	EUR	90,59	90,59		82 255,72
iShares Physical Silver ETC	1 430,00	USD	26,76	32,73		31 284,92
SUB-TOTAL						2 025 880,72
32 Fundos não harmonizados						
INDICO ACCELERATION SUB-FUND I GENERAL	14 466,73	EUR	1,00	1,00		14 466,73
SUB-TOTAL						14 466,73
4 Imobiliário						
42 U. P.'s de fundos de investimento imobiliário						
CA Património Crescente	6 727,00	EUR	18,50	18,50		124 474,39
SUB-TOTAL						124 474,39
5 Liquidez						
51 À vista						
BIG Global Trade		EUR				500,00
SUB-TOTAL						500,00
512 Depósitos à ordem						
BIG - Banco de Investimento Global		EUR				88 604,06
Cx. Crédito Agrícola Mútuoo		EUR				173,15
GOLDEN CC EURO		EUR				18 500,57



	GOLDEN CONTA MARGEM EURO		EUR				-10,93
	GOLDEN FUTURO		USD				-132,88
	GOLDEN INDICO		EUR				3 867,15
	SUB-TOTAL						111 001,12
7	Operações com produtos derivados						
71	Em mercado regulamentado						
711	Futuros						
	E-mini EURUSD - Jun 21	2,00	USD	1,22	1,49		0,00
712	Opções						
	Put SPY US 10/15/21 P400	6,00	USD	1 100,00	1 345,24		5 396,82
	SUB-TOTAL						5 396,82
9	Outros valores a regularizar						8 955,36
	TOTAL DE APLICAÇÕES						2 518 703,75
	TOTAL DO FUNDO						2 527 659,11

Lisboa, 31 de Maio de 2021