

## Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 31/10/2021 5,95484 EUR  
 N.º Unidades de Participação em circulação 983 930,8987

	Quantidade	Moeda	Cot. Moeda	Cot. Euro	Jur Dec	Valor (Euro)
<b>1 Valores mobiliários cotados</b>						
<b>11 Mercado cot. ofic. de B.V. Port.</b>						
<b>114 Acções</b>						
BES	35 430,00	EUR				0,00
<b>12 Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE</b>						
<b>123 Obrigações diversas</b>						
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	100,68	100,68	337,50	101 013,50
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>101 113,50</b>
<b>124 Acções</b>						
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	3 369,00	EUR	28,55	28,55		96 184,95
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)	716,00	EUR	148,58	148,58		106 383,28
iShares Edge MSCI EM Value	1 485,00	EUR	37,75	37,75		56 058,75
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>258 626,98</b>
<b>3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo</b>						
<b>31 Fundos harmonizados</b>						
AMUNDI MSCI EM ASIA UCITS ETF	3 146,00	EUR	37,24	37,24		117 162,39
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	1 338,33	EUR	185,61	185,61		248 407,99
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	1 483,17	EUR	161,04	161,04		238 849,70
CANDRIAM Euro High Yield	134,36	EUR	1 380,94	1 380,94		185 536,19
Candriam Long Short Global Credit	829,95	EUR	105,81	105,81		87 816,69
Central Fund Canada LTD	8 763,00	USD	18,07	20,90		136 923,01
DPAM INVEST B Equities NewGems Sustainable	260,76	EUR	324,16	324,16		84 526,34
FUNDSMITH Equity Fund	3 323,45	EUR	57,13	57,13		189 868,70
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	21 556,42	EUR	14,36	14,36		309 550,19
KEMPEN Euro Credit	229,82	EUR	1 528,77	1 528,77		351 341,92
Kopernik Global All-Cap Equity Fund	738,11	EUR	217,09	217,09		160 240,06
LYXOR BUND FUTURE DAILY(-1X) INVERSE UCITS ETF	8 811,00	EUR	51,47	51,47		453 519,79
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	586,23	EUR	151,97	151,97		89 089,37
MAN GLG European Inc Opportunities	970,04	EUR	121,04	121,04		117 413,76
Nordea 1 Low Duration European Covered Bond BI EUR	1 096,79	EUR	103,83	103,83		113 879,29
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	2 120,88	EUR	42,73	42,73		90 625,26
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	3 765,00	USD	40,10	46,37		130 549,38
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	8 301,00	EUR	27,64	27,64		229 398,14
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	20 322,82	EUR	3,31	3,31		67 268,52
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	6 039,00	USD	30,40	35,16		158 746,47
Vaneck Vectors Gold Miners UCITS ETF	2 461,00	EUR	29,43	29,43		72 414,93
Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	1 581,51	EUR	110,65	110,65		174 994,08
iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist	63 788,00	EUR	4,82	4,82		307 222,14
iShares Global Inflation Linked Govt Bond	2 112,00	EUR	164,90	164,90		348 268,80
iShares J.P.Morgan \$EMBond EUR Hgd UCITS ETF(Dist)	1 831,00	EUR	88,78	88,78		162 556,18
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>4 626 169,29</b>
<b>32 Fundos não harmonizados</b>						
BANIF Global Private Equity Fund - FCR	666,67	EUR	0,19	0,19		124,51
INDICO ACCELERATION SUB-FUND I GENERAL	114 000,00	EUR	0,15	0,15		17 138,76
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>17 263,27</b>
<b>4 Imobiliário</b>						
<b>42 U. P.'s de fundos de investimento imobiliário</b>						



CA Património Crescente	14 737,00	EUR	18,88	18,88	278 234,56
SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN	421,00	EUR	6,34	6,34	2 669,14
SEB Immoinvest	729,00	EUR	1,03	1,03	750,87
<b>SUB-TOTAL</b>					<b>281 654,57</b>
<b>5 Liquidez</b>					
<b>51 À vista</b>					
<b>512 Depósitos à ordem</b>					
BBVA - €		EUR			406,30
BIG - Banco de Investimento Global	1,00	EUR	1 187,24	1 187,24	1 187,24
CGD-EUR		EUR			472,59
Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			125,49
GOLDEN CC EURO		EUR			68 707,92
GOLDEN CONTA MARGEM EURO		EUR			15 287,20
GOLDEN CONTA MARGEM USD		USD			4 492,54
GOLDEN FUTURO		USD			-4 448,67
GOLDEN INDICO		EUR			3 927,76
Millenium USD		USD			-0,02
Millenium bcp		EUR			494 552,98
<b>SUB-TOTAL</b>					<b>584 711,33</b>
<b>7 Operações com produtos derivados</b>					
<b>71 Em mercado regulamentado</b>					
<b>711 Futuros</b>					
E-mini EURUSD - Dez 2021	2,00	USD	1,16	1,34	0,00
<b>9 Outros valores a regularizar</b>					<b>-10 384,08</b>
<b>TOTAL DE APLICAÇÕES</b>					<b>5 869 538,94</b>
<b>TOTAL DO FUNDO</b>					<b>5 859 154,86</b>

Lisboa, 31 de Outubro de 2021