

Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 31/03/2022 5,89492 EUR
 N.º Unidades de Participação em circulação 1 402 455,9747

Quantidade Moeda Cot. Moeda Cot. Euro Jur Dec Valor (Euro)

| | 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 | | | | | | |
| 123 Obrigações diversas | | | | | | |
| OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021) | 2 000,00 | EUR | 5,00 | 5,00 | | 100,00 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 100,00 |
| 124 Acções | | | | | | |
| SPDR MSCI World Energy UCITS ETF | 3 591,00 | EUR | 37,88 | 37,88 | | 136 027,08 |
| iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc) | 808,00 | EUR | 157,28 | 157,28 | | 127 082,24 |
| iShares Edge MSCI EM Value | 3 361,00 | EUR | 38,76 | 38,76 | | 130 255,56 |
| iShares MSCI World Value Factor UCITS | 3 564,00 | EUR | 33,82 | 33,82 | | 120 516,66 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 513 881,54 |
| 3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo | | | | | | |
| 31 Fundos harmonizados | | | | | | |
| BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov. | 1 995,88 | EUR | 174,30 | 174,30 | | 347 881,54 |
| Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return | 1 871,14 | EUR | 161,89 | 161,89 | | 302 918,85 |
| CANDRIAM Euro High Yield | 179,40 | EUR | 1 324,40 | 1 324,40 | | 237 594,71 |
| Candriam Long Short Global Credit | 829,95 | EUR | 105,41 | 105,41 | | 87 484,71 |
| Sprott Physical Gold and Silver Trust (CEF) | 20 060,00 | USD | 19,38 | 21,45 | | 351 208,31 |
| FUNDSMITH Equity Fund | 4 041,62 | EUR | 55,12 | 55,12 | | 222 756,31 |
| JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY | 32 468,15 | EUR | 13,72 | 13,72 | | 445 463,02 |
| KEMPEN Euro Credit | 202,46 | EUR | 1 441,86 | 1 441,86 | | 291 918,98 |
| Kopernik Global All-Cap Equity Fund | 912,62 | EUR | 202,69 | 202,69 | | 184 975,75 |
| KraneShares CSI China Internet ETF EUR | 7 968,00 | EUR | 12,35 | 12,35 | | 98 388,86 |
| L&G Emerging Markets Short Duration | 194 414,27 | EUR | 1,01 | 1,01 | | 195 658,52 |
| LYXOR BUND FUTURE DAILY(-1X) INVERSE UCITS ETF | 11 008,00 | EUR | 53,83 | 53,83 | | 592 538,62 |
| MAN AHL Trend Alternative IN HEUR | 797,63 | EUR | 146,66 | 146,66 | | 116 980,56 |
| MAN GLG European Inc Opportunities | 1 047,55 | EUR | 118,99 | 118,99 | | 124 647,62 |
| Nordea 1 Low Duration European Covered Bond BI EUR | 1 933,00 | EUR | 102,87 | 102,87 | | 198 847,92 |
| ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR | 2 729,45 | EUR | 42,68 | 42,68 | | 116 492,93 |
| PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD | 4 710,00 | USD | 39,50 | 43,72 | | 168 073,05 |
| SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF | 11 918,00 | EUR | 27,36 | 27,36 | | 326 016,89 |
| Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund | 20 322,82 | EUR | 3,16 | 3,16 | | 64 277,00 |
| THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS | 7 599,00 | USD | 25,00 | 27,67 | | 171 623,41 |
| Vaneck Vectors Gold Miners UCITS ETF | 3 462,00 | EUR | 37,78 | 37,78 | | 130 794,36 |
| Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund | 2 197,81 | EUR | 107,91 | 107,91 | | 237 165,89 |
| iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist | 87 216,00 | EUR | 5,10 | 5,10 | | 445 098,13 |
| iShares Global Inflation Linked Govt Bond | 3 099,00 | EUR | 164,72 | 164,72 | | 510 451,79 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 5 969 257,73 |
| 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 | 114 000,00 | EUR | 0,18 | 0,18 | | 20 341,02 |
| Shilling - subs pendente | | EUR | | | | -58 500,00 |
| Shilling Fund | 650,00 | EUR | 99,19 | 99,19 | | 64 473,50 |
| SUB-TOTAL | | | | | | 26 439,03 |
| 4 Imobiliário | | | | | | |
| 42 U. P.'s de fundos de investimento imobiliário | | | | | | |
| CA Património Crescente | 14 737,00 | EUR | 19,35 | 19,35 | | 285 107,90 |



| | | | | | |
|---|--------|-----|------|------|---------------------|
| SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN | 421,00 | EUR | 6,33 | 6,33 | 2 664,93 |
| SEB Immoinvest | 729,00 | EUR | 0,71 | 0,71 | 513,95 |
| SUB-TOTAL | | | | | 288 286,78 |
| 5 Liquidez | | | | | |
| 51 À vista | | | | | |
| 512 Depósitos à ordem | | | | | |
| BBVA - € | | EUR | | | 454,84 |
| CGD-EUR | | EUR | | | 329,51 |
| Cx. Crédito Agrícola Mútuo | | EUR | | | 2,49 |
| GOLDEN CC EURO | | EUR | | | 66 878,15 |
| GOLDEN CONTA MARGEM EURO | | EUR | | | 5 951,60 |
| GOLDEN CONTA MARGEM USD | | USD | | | 4 677,34 |
| GOLDEN FUTURO | | USD | | | 180,94 |
| GOLDEN INDICO | | EUR | | | -9,59 |
| Millenium USD | | USD | | | 324,99 |
| Millenium bcp | | EUR | | | 1 404 068,10 |
| SUB-TOTAL | | | | | 1 482 858,37 |
| 7 Operações com produtos derivados | | | | | |
| 71 Em mercado regulamentado | | | | | |
| 711 Futuros | | | | | |
| E-mini EURUSD - Jun 2022 | 4,00 | USD | 1,11 | 1,23 | 0,00 |
| 9 Outros valores a regularizar | | | | | -13 462,40 |
| TOTAL DE APLICAÇÕES | | | | | 8 280 823,45 |
| TOTAL DO FUNDO | | | | | 8 267 361,05 |

Lisboa, 31 de Março de 2022