

## Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 31/05/2022 5,76646 EUR

N.º Unidades de Participação em circulação 1 603 035,5399

	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
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>100,00</b>
<b>124 Acções</b>						
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	3 591,00	EUR	43,84	43,84		157 429,44
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)	808,00	EUR	158,90	158,90		128 391,20
iShares Edge MSCI EM Value	3 361,00	EUR	38,22	38,22		128 457,42
iShares MSCI World Value Factor UCITS	3 564,00	EUR	33,98	33,98		121 104,72
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>535 382,78</b>
<b>3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo</b>						
<b>31 Fundos harmonizados</b>						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	1 995,88	EUR	167,31	167,31		333 930,35
BSF European Opportunities Extension D2 EUR	79,35	EUR	541,89	541,89		42 998,97
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	1 871,14	EUR	155,59	155,59		291 130,67
CANDRIAM Euro High Yield	220,31	EUR	1 271,34	1 271,34		280 085,10
Candriam Long Short Global Credit	829,95	EUR	105,13	105,13		87 252,33
FUNDSMITH Equity Fund	4 041,62	EUR	51,71	51,71		208 999,45
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	26 731,83	EUR	13,13	13,13		350 988,93
KEMPEN Euro Credit	202,46	EUR	1 398,57	1 398,57		283 154,48
Kopernik Global All-Cap Equity Fund	1 208,96	EUR	200,79	200,79		242 748,73
KraneShares CSI China Internet ETF EUR	10 455,00	EUR	12,90	12,90		134 827,68
L&G Emerging Markets Short Duration	233 569,08	EUR	0,98	0,98		227 776,57
ETF LYXOR BUND FUTURE DAILY(-1X) INVERSE UCITS	10 718,00	EUR	56,14	56,14		601 729,96
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	797,63	EUR	153,41	153,41		122 364,57
MAN GLG European Inc Opportunities	569,55	EUR	118,16	118,16		67 297,67
EUR Nordea 1 Low Duration European Covered Bond BI	2 243,86	EUR	102,37	102,37		229 704,15
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	2 729,45	EUR	40,09	40,09		109 423,65
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	6 163,00	USD	32,35	34,73		185 696,06
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	14 472,00	EUR	26,99	26,99		390 642,70
Sprott Physical Gold and Silver Trust (CEF)	23 083,00	USD	17,40	18,68		374 091,41
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	20 322,82	EUR	3,09	3,09		62 750,76
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	7 599,00	USD	24,10	25,88		170 572,78
Vaneck Vectors Gold Miners UCITS ETF	4 376,00	EUR	32,33	32,33		141 454,20
Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	2 560,10	EUR	106,54	106,54		272 752,73
iShares \$ Treasury Bd 20+y UCITS ETF EUR Hgd						
Dist	43 506,00	EUR	4,23	4,23		183 888,99
iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist	100 651,00	EUR	5,07	5,07		510 199,92
iShares Global Inflation Linked Govt Bond	3 759,00	EUR	155,74	155,74		585 426,66
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>6 491 889,47</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	0,21	0,21		24 179,40
Shilling - subs pendente		EUR				-58 500,00
Shilling Fund	650,00	EUR	99,43	99,43		64 629,50
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>30 433,41</b>



<b>4</b>	<b>Imobiliário</b>						
<b>42</b>	<b>U. P.'s de fundos de investimento imobiliário</b>						
	CA Património Crescente	14 737,00	EUR	19,59	19,59		288 683,09
	SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN	421,00	EUR	4,91	4,91		2 067,11
	SEB Immoinvest	729,00	EUR	0,73	0,73		529,25
	<b>SUB-TOTAL</b>						<b>291 279,45</b>
<b>5</b>	<b>Liquidez</b>						
<b>51</b>	<b>À vista</b>						
<b>512</b>	<b>Depósitos à ordem</b>						
	BBVA - €		EUR				930,17
	CGD-EUR	1,00	EUR				345,62
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR				29,49
	GOLDEN CC EURO		EUR				61 828,15
	GOLDEN CONTA MARGEM EURO		EUR				10 944,99
	GOLDEN CONTA MARGEM USD		USD				4 822,31
	GOLDEN FUTURO		USD				-8 126,19
	GOLDEN INDICO		EUR				17,49
	Millenium USD		USD				0,01
	Millenium bcp		EUR				2 113 887,73
	<b>SUB-TOTAL</b>						<b>2 184 679,77</b>
<b>7</b>	<b>Operações com produtos derivados</b>						
<b>71</b>	<b>Em mercado regulamentado</b>						
<b>711</b>	<b>Futuros</b>						
	E-mini EURUSD - Jun 2022	4,00	USD	1,07	1,15		0,00
<b>9</b>	<b>Outros valores a regularizar</b>						<b>-289 918,35</b>
	<b>TOTAL DE APLICAÇÕES</b>						<b>9 533 764,88</b>
	<b>TOTAL DO FUNDO</b>						<b>9 243 846,53</b>

Lisboa, 31 de Maio de 2022