

## Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 31/05/2023 5,6432 EUR

N.º Unidades de Participação em circulação 1 767 757,5482

	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>111 Títulos de dívida pública</b>						
BUBILL 0 01/17/24	495 000,00	EUR	98,02	98,02		485 184,15
BUBILL 0 02/21/24	500000	EUR	97,011	97,011		485055
BUBILL 0 11/22/23	727 000,00	EUR	98,53	98,53		716 305,83
DBR 1 1/2 05/15/24	250 000,00	EUR	98,65	98,65	156,25	246 775,00
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>1 933 319,98</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>						0,00
<b>123 Obrigações diversas</b>						
OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	2 000,00	EUR	4,70	4,70		94,00
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>94,00</b>
<b>124 Acções</b>						
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	2 492,00	EUR	39,53	39,53		98 508,76
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)	808,00	EUR	159,64	159,64		128 989,12
iShares Edge MSCI EM Value	3 361,00	EUR	35,65	35,65		119 802,85
iShares MSCI World Value Factor UCITS	3 564,00	EUR	33,15	33,15		118 146,60
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>465 447,33</b>
<b>3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo</b>						
<b>31 Fundos harmonizados</b>						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 703,40	EUR	157,79	157,79		426 568,70
BSF European Opportunities Extension D2 EUR	318,01	EUR	585,32	585,32		186 137,61
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	2 368,40	EUR	161,98	161,98		383 633,43
CANDRIAM Euro High Yield	96,31	EUR	1 301,05	1 301,05		125 300,22
FUNDSMITH Equity Fund	4 882,70	EUR	54,82	54,82		267 659,36
ISHARES EURO INFL GOVT	2 844,00	EUR	224,52	224,52		638 534,88
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	28 528,70	EUR	12,50	12,50		356 608,75
KEMPEN Euro Credit	263,90	EUR	1 354,95	1 354,95		357 571,31
Kopernik Global All-Cap Equity Fund	1 385,37	EUR	202,10	202,10		279 984,12
KraneShares CSI China Internet ETF EUR	10 455,00	EUR	10,89	10,89		113 886,32
L&G Emerging Markets Short Duration	369 358,82	EUR	0,95	0,95		352 552,99
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	910,19	EUR	157,96	157,96		143 774,24
MONTLAKE-INVENOMIC US EQ. L/S(INS.PO.	1 148,45	EUR	128,89	128,89		148 019,89
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	3 086,08	EUR	48,53	48,53		149 767,62
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	6 613,00	USD	34,05	36,30		211 222,49
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	14 472,00	EUR	27,59	27,59		399 224,59
Sprott Physical Gold and Silver Trust (CEF)	25 224,00	USD	18,58	19,81		439 519,09
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	20 322,82	EUR	3,05	3,05		62 059,78
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	9 606,00	USD	19,00	20,26		171 154,57
Vaneck Vectors Gold Miners UCITS ETF	5 106,00	EUR	31,98	31,98		163 264,35
Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	2 703,71	EUR	103,53	103,53		279 914,68
iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	69 908,00	EUR	3,60	3,60		251 326,25
iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist	85 709,00	EUR	4,83	4,83		413 674,49
iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF	72 950,00	EUR	4,11	4,11		299 853,68
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>6 621 213,41</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	0,46	0,46	52 230,24
INDICO VC FUND I – FCR CAT A	250 000,00	EUR	1,22	1,22	306 128,85
Shilling - subs pendente		EUR			-58 500,00
Shilling Fund	650,00	EUR	100,72	100,72	65 468,00
<b>SUB-TOTAL</b>					<b>365 451,60</b>
<b>4 Imobiliário</b>					
<b>42 U. P.'s de fundos de investimento imobiliário</b>					
CA Património Crescente	18 797,00	EUR	20,46	20,46	384 579,10
SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	421,00	EUR	3,95	3,95	1 662,95
SEB Immoinvest	729,00	EUR	0,65	0,65	473,85
<b>SUB-TOTAL</b>					<b>386 715,90</b>
<b>5 Liquidez</b>					
<b>51 À vista</b>					
<b>512 Depósitos à ordem</b>					
BBVA - €		EUR			546,09
CGD-EUR	1,00	EUR			123,36
Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			172,32
GOLDEN CC EURO		EUR			158,15
GOLDEN CONTA MARGEM EURO		EUR			152 146,72
GOLDEN CONTA MARGEM USD		USD			4 842,51
GOLDEN FUTURO		USD			-12 369,84
GOLDEN INDICO		EUR			14,36
Millenium bcp		EUR			32 372,73
<b>SUB-TOTAL</b>					<b>178 006,40</b>
<b>7 Operações com produtos derivados</b>	52 000,00	EUR			0,00
<b>71 Em mercado regulamentado</b>					
<b>711 Futuros</b>					
E-Mini EURUSD - Jun 2023	13,00	USD	1,07	1,14	0,00
<b>9 Outros valores a regularizar</b>					<b>-22 542,69</b>
<b>TOTAL DE APLICAÇÕES</b>					<b>9 950 248,62</b>
<b>TOTAL DO FUNDO</b>					<b>9 927 705,93</b>

Lisboa, 31 de Maio de 2023