

Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 31/07/2023 5,624 EUR
 N.º Unidades de Participação em circulação 1 766 662,567

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.						
111 Títulos de dívida pública						
BUBILL 0 01/17/24	495 000,00	EUR	98,37	98,37		486 921,60
BUBILL 0 02/21/24	500 000,00	EUR	97,18	97,18		485 920,00
BUBILL 0 11/22/23	474 000,00	EUR	98,92	98,92		468 861,84
DBR 11/2 05/15/24	250 000,00	EUR	98,55	98,55		247 160,00
SUB-TOTAL						1 688 863,44
114 Acções						
BES (NPR)	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	4,70	4,70		94,00
SUB-TOTAL						94,00
124 Acções						
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	2 492,00	EUR	43,28	43,28		107 853,76
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)	808,00	EUR	166,12	166,12		134 224,96
iShares Edge MSCI EM Value	3 361,00	EUR	38,55	38,55		129 549,75
iShares MSCI World Value Factor UCITS	3 564,00	EUR	35,69	35,69		127 199,16
SUB-TOTAL						498 827,63
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 703,40	EUR	157,68	157,68		426 271,32
BSF European Opportunities Extension D2 EUR	318,01	EUR	590,54	590,54		187 797,63
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	2 368,40	EUR	156,14	156,14		369 801,98
CANDRIAM Euro High Yield	96,31	EUR	1 328,48	1 328,48		127 941,92
FUNDSMITH Equity Fund	4 882,70	EUR	56,66	56,66		276 649,88
ISHARES EURO INFL GOVT	2 844,00	EUR	225,08	225,08		640 127,52
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	28 528,70	EUR	12,42	12,42		354 326,45
KEMPEN Euro Credit	263,90	EUR	1 360,08	1 360,08		358 925,11
Kopernik Global All-Cap Equity Fund	1 385,37	EUR	205,21	205,21		284 294,42
KraneShares CSI China Internet ETF EUR	10 455,00	EUR	13,69	13,69		143 087,13
L&G Emerging Markets Short Duration	369 425,74	EUR	0,98	0,98		362 702,19
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	910,19	EUR	155,41	155,41		141 453,25
MONTLAKE-INVENOMIC US EQ.L/S(INS.PO.	1 148,45	EUR	129,24	129,24		148 423,57
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	3 086,08	EUR	53,70	53,70		165 722,67
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	6 613,00	USD	38,50	35,01		231 508,23
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	14 472,00	EUR	27,92	27,92		404 116,13
Sprott Physical Gold and Silver Trust (CEF)	25 224,00	USD	18,70	17,00		428 906,63
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	20 322,82	EUR	3,06	3,06		62 159,36
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	8 171,00	USD	19,80	18,00		147 111,83
Vaneck Vectors Gold Miners UCITS ETF	5 106,00	EUR	31,36	31,36		160 098,63
Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	2 703,71	EUR	104,06	104,06		281 347,65
iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	69 908,00	EUR	3,35	3,35		234 254,72
iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist	85 709,00	EUR	4,63	4,63		396 404,13
iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF	72 950,00	EUR	4,09	4,09		298 518,70
SUB-TOTAL						6 631 951,05



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	0,46	0,46	52 230,24
	INDICO VC FUND I – FCR CAT A	250 000,00	EUR	1,11	1,11	276 685,00
	Shilling - subs pendente		EUR			-58 500,00
	Shilling Fund	650,00	EUR	100,72	100,72	65 468,00
	SUB-TOTAL					336 007,75
4	Imobiliário					
42	U. P.'s de fundos de investimento imobiliário					
	CA Património Crescente	18 797,00	EUR	20,61	20,61	387 340,38
	SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN	421,00	EUR	3,96	3,96	1 667,16
	SEB Immoinvest	729,00	EUR	0,76	0,76	554,04
	SUB-TOTAL					389 561,58
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			1 330,84
	BIG - Banco de Investimento Global	1,00	EUR			
	CGD-EUR		EUR			112,96
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			172,32
	GOLDEN CC EURO		EUR			158,15
	GOLDEN CONTA MARGEM EURO		EUR			166 660,95
	GOLDEN CONTA MARGEM USD		USD			-5 207,34
	GOLDEN FUTURO		USD			-6 359,04
	GOLDEN INDICO		EUR			-12,92
	Millenium bcp		EUR			264 222,14
	SUB-TOTAL					421 078,06
7	Operações com produtos derivados					
71	Em mercado regulamentado					
711	Futuros					
	E-mini EURUSD - Set 2023	13,00	USD	1,10	1,00	
	SUB-TOTAL					
712	Opções					
	Put SPY US 17/11/23 P430	21	USD	490,0001571	445,5571429	9356,7
9	Outros valores a regularizar					-40143,6
	TOTAL DE APLICAÇÕES					9 975 740,21
	TOTAL DO FUNDO					9 935 596,61

Lisboa, 31 de Julho de 2023