

## Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Equilibrada

Valor Patrimonial Unitário em 31/07/2023 8,978 EUR  
 N.º Unidades de Participação em circulação 1 630 458,683

	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	740 000,00	EUR	98,37	98,37		727 923,20
BUBILL 0 02/21/24	775 000,00	EUR	97,18	97,18		753 176,00
BUBILL 0 03/20/24	200 000,00	EUR	97,18	97,18		194 368,00
BUBILL 0 11/22/23	0,00	EUR				
DBR 1 1/2 05/15/24	260 000,00	EUR	98,55	98,55		257 046,40
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>1 932 513,60</b>
<b>114 Acções</b>						
BES (NPR)	123532	EUR				0
<b>12 Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE</b>						
<b>123 Obrigações diversas</b>						
ESF 6.875% 10/2019	100 000,00	EUR	0,01	0,01		10,00
OREY Best Of 08/07/2031 (ex-2018, ex-2021)	16 000,00	EUR	4,70	4,70		752,00
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>762,00</b>
<b>124 Acções</b>						
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	5 486,00	EUR	43,28	43,28		237 434,08
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)	1 227,00	EUR	166,12	166,12		203 829,24
iShares Edge MSCI EM Value	6 347,00	EUR	38,55	38,55		244 645,12
iShares MSCI World Value Factor UCITS	7 947,00	EUR	35,69	35,69		283 628,43
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>969 536,87</b>
<b>3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo</b>						
<b>31 Fundos harmonizados</b>						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	3 831,99	EUR	157,68	157,68		604 228,18
BSF European Opportunities Extension D2 EUR	511,43	EUR	590,54	590,54		302 019,87
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	3 782,90	EUR	156,14	156,14		590 662,01
CANDRIAM Euro High Yield	135,91	EUR	1 328,48	1 328,48		180 555,05
FUNDSMITH Equity Fund	11 163,17	EUR	56,66	56,66		632 496,28
ISHARES EURO INFL GOVT	4 108,00	EUR	225,08	225,08		924 628,64
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	42 143,89	EUR	12,42	12,42		523 427,11
KEMPEN Euro Credit	291,11	EUR	1 360,08	1 360,08		395 932,89
Kopernik Global All-Cap Equity Fund	3 264,36	EUR	205,21	205,21		669 887,32
KraneShares CSI China Internet ETF EUR	22 413,00	EUR	13,69	13,69		306 744,32
L&G Emerging Markets Short Duration	596 604,75	EUR	0,98	0,98		585 746,54
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	1 400,59	EUR	155,41	155,41		217 665,69
MONTLAKE-INVENOMIC US EQ.L/S(INNS.PO.	1 726,47	EUR	129,24	129,24		223 126,82
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	5 960,94	EUR	53,70	53,70		320 102,22
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	12 961,00	USD	38,50	35,01		453 739,34
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	20 785,00	EUR	27,92	27,92		580 400,34
Sprott Physical Gold and Silver Trust (CEF)	46 470,00	USD	18,70	17,00		790 171,70
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	53 996,61	EUR	3,06	3,06		165 154,04
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	15 935,00	USD	19,80	18,00		286 895,97
Vaneck Vectors Gold Miners UCITS ETF	11 485,00	EUR	31,35	31,35		360 112,17
iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	112 321,00	EUR	3,35	3,35		376 376,44
iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist	114 799,00	EUR	4,63	4,63		530 945,38
iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF	72 460,00	EUR	4,09	4,09		296 513,57
<b>SUB-TOTAL</b>						<b>10 317 531,89</b>



<b>32 Fundos não harmonizados</b>					
BANIF Global Private Equity Fund - FCR	53 325,91	EUR	0,19	0,19	9 959,68
INDICO ACCELERATION SUB-FUND I GENERAL	75 000,00	EUR	0,46	0,46	34 362,00
INDICO VC FUND I – FCR CAT A	250 000,00	EUR	1,11	1,11	276 685,00
Shilling - subs pendente		EUR			-49 500,00
Shilling Fund	550,00	EUR	100,72	100,72	55 396,00
<b>SUB-TOTAL</b>					<b>326 902,68</b>
<b>4 Imobiliário</b>					
<b>42 U. P.'s de fundos de investimento imobiliário</b>					
CA Património Crescente	18 144,00	EUR	20,61	20,61	373 884,34
SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN	1 485,00	EUR	3,96	3,96	5 880,60
SEB Immoinvest	1 847,00	EUR	0,76	0,76	1 403,72
<b>SUB-TOTAL</b>					<b>381 168,66</b>
<b>5 Liquidez</b>					
<b>51 À vista</b>					
<b>512 Depósitos à ordem</b>					
BBVA - €		EUR			3 495,54
Cx. Crédito Agrícola Mútu		EUR			180,53
GOLDEN CC EURO		EUR			367,56
GOLDEN CONTA MARGEM EURO		EUR			144 659,51
GOLDEN CONTA MARGEM USD		USD			-25 350,30
GOLDEN FUTURO		USD			12 745,96
GOLDEN INDICO		EUR			66,82
Millenium bcp		EUR			570 696,43
<b>SUB-TOTAL</b>					<b>706 862,05</b>
<b>7 Operações com produtos derivados</b>					
<b>71 Em mercado regulamentado</b>					
<b>711 Futuros</b>					
E-mini EURUSD - Set 2023	24	USD	1,10245	1,002457785	
<b>SUB-TOTAL</b>					
<b>712 Opções</b>					
Put SPY US 17/11/23 P430	62	USD	489,999929	445,5569355	27624,53
<b>9 Outros valores a regularizar</b>					<b>-24019,02</b>
<b>TOTAL DE APLICAÇÕES</b>					<b>14 662 902,28</b>
<b>TOTAL DO FUNDO</b>					<b>14 638 883,26</b>

Lisboa, 31 de Julho de 2023