

Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Conservadora

Valor Patrimonial Unitário em 30/09/2023 5,540 EUR
 N.º Unidades de Participação em circulação 1 755 120,292

	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	98,93	98,93		489 693,60
BUBILL 0 02/21/24	500 000,00	EUR	96,52	96,52		482 580,00
BUBILL 0 11/22/23	349 000,00	EUR	99,50	99,50		347 255,00
DBR 11/2 05/15/24	250 000,00	EUR	98,72	98,72		248 216,25
SUB-TOTAL						1 567 744,85
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	47,35	47,35		117 996,20
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)	808,00	EUR	164,06	164,06		132 560,48
iShares Edge MSCI EM Value	3 361,00	EUR	38,08	38,08		127 986,88
iShares MSCI World Value Factor UCITS	3 564,00	EUR	35,67	35,67		127 127,88
SUB-TOTAL						505 671,44
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	2 703,40	EUR	152,89	152,89		413 322,06
BSF European Opportunities Extension D2 EUR	318,01	EUR	570,41	570,41		181 396,08
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	1 428,40	EUR	158,61	158,61		226 558,52
CANDRIAM Euro High Yield	96,31	EUR	1 326,34	1 326,34		127 735,83
FUNDSMITH Equity Fund	4 882,70	EUR	54,69	54,69		267 018,75
ISHARES EURO INFL GOVT	2 844,00	EUR	216,44	216,44		615 555,36
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	28 528,70	EUR	12,16	12,16		346 908,99
KEMPEN Euro Credit	263,90	EUR	1 342,31	1 342,31		354 235,61
Kopernik Global All-Cap Equity Fund	1 385,37	EUR	213,88	213,88		296 302,92
KraneShares CSI China Internet ETF EUR	10 455,00	EUR	12,32	12,32		128 805,60
L&G Emerging Markets Short Duration	369 493,43	EUR	0,96	0,96		355 969,97
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	910,19	EUR	160,77	160,77		146 331,89
MONTLAKE-INVENOMIC US EQ. L/S (INS.PO.	1 846,58	EUR	132,19	132,19		244 093,08
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	3 086,08	EUR	58,48	58,48		180 474,15
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	6 613,00	USD	36,40	34,42		227 642,47
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	14 472,00	EUR	27,29	27,29		394 955,35
Sprott Physical Gold and Silver Trust (CEF)	26 140,00	USD	17,32	16,38		428 160,76
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	20 322,82	EUR	3,00	3,00		60 962,35
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	8 171,00	USD	18,87	17,85		145 853,06
Vaneck Vectors Gold Miners UCITS ETF	5 106,00	EUR	27,79	27,79		141 895,74
Vontobel Fund - TwentyFour Abs. Ret.Credit Fund	2 703,71	EUR	104,64	104,64		282 915,80
iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	69 908,00	EUR	3,12	3,12		218 273,75
iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist	85 709,00	EUR	4,73	4,73		405 497,85
iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF	72 950,00	EUR	3,99	3,99		291 216,40
SUB-TOTAL						6 482 082,34

32	Fundos não harmonizados					
	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					335 883,24
4	Imobiliário					
42	U. P.'s de fundos de investimento imobiliário					
	CA Património Crescente	18 797,00	EUR	20,77	20,77	390 477,60
	SEB IMMOPTFOLIO TARGET RETURN	421,00	EUR	3,98	3,98	1 675,58
	SEB Immoinvest	729,00	EUR	0,76	0,76	550,40
	SUB-TOTAL					392 703,58
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			900,34
	BIG - Banco de Investimento Global	1,00	EUR			0,00
	CGD-EUR		EUR			92,16
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			172,32
	GOLDEN CC EURO		EUR			158,15
	GOLDEN CONTA MARGEM EURO		EUR			146 785,31
	GOLDEN CONTA MARGEM USD		USD			-5 415,80
	GOLDEN FUTURO		USD			-20 408,18
	GOLDEN INDICO		EUR			-12,92
	Millenium bcp		EUR			332 106,76
	SUB-TOTAL					454 378,14
7	Operações com produtos derivados					
71	Em mercado regulamentado					
711	Futuros					
	E-Mini EURUSD - Dez 2023	12,00	USD	1,06	1,00	0,00
	SUB-TOTAL					
712	Opções					
	Put SPY US 17/11/23 P430	21	USD	949,0002367	897,4695238	18846,86
9	Outros valores a regularizar					-33299,19
	TOTAL DE APLICAÇÕES					9757404,45
	TOTAL DO FUNDO					9724105,26

Lisboa, 30 de Setembro de 2023