

Fundo de Pensões Aberto SGF Reforma Equilibrada

Valor Patrimonial Unitário em 30/09/2023 8,828 EUR
 N.º Unidades de Participação em circulação 1 662 623,691

	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	740 000,00	EUR	98,93	98,93		732 067,20
BUBILL 0 02/21/24	775 000,00	EUR	96,52	96,52		747 999,00
DBR 1 1/2 05/15/24	260000,00	EUR	98,724	98,724		258144,9
SUB-TOTAL						1 738 211,10
114 Ações						
BES (NPR)	123 532,00	EUR				0,00
12 Mercado cot. ofic. de B.V. outros Est. Membro da UE						
123 Obrigações diversas						
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
SUB-TOTAL						762,00
124 Ações						
SPDR MSCI World Energy UCITS ETF	5 700,00	EUR	47,35	47,35		269 895,01
iShares Core FTSE 100 UCITS ETF GBP (Acc)	1 473,00	EUR	164,06	164,06		241 660,38
iShares Edge MSCI EM Value	6 347,00	EUR	38,08	38,08		241 693,76
iShares MSCI World Value Factor UCITS	7 947,00	EUR	35,67	35,67		283 469,49
SUB-TOTAL						1 036 718,64
3 U. P.'s de Instituições de Investimento Colectivo						
31 Fundos harmonizados						
BLUEBAY Inv. Grade Euro Gov.	3 831,99	EUR	152,89	152,89		585 872,95
BSF European Opportunities Extension D2 EUR	541,07	EUR	570,41	570,41		308 631,74
Blackrock Strategic Funds-EUR Abs.Return	3 782,90	EUR	158,61	158,61		600 005,77
CANDRIAM Euro High Yield	135,91	EUR	1 326,34	1 326,34		180 264,20
FUNDSMITH Equity Fund	11 773,91	EUR	54,69	54,69		643 876,28
ISHARES EURO INFL GOVT	4 108,00	EUR	216,44	216,44		889 135,52
JUPITER JGF - Dinamic Bond - DY	42 143,89	EUR	12,16	12,16		512 469,70
KEMPEN Euro Credit	291,11	EUR	1 342,31	1 342,31		390 759,86
Kopernik Global All-Cap Equity Fund	3 264,36	EUR	213,88	213,88		698 183,15
KraneShares CSI China Internet ETF EUR	22 413,00	EUR	12,32	12,32		276 128,16
L&G Emerging Markets Short Duration	596 714,06	EUR	0,96	0,96		574 874,33
MAN AHL Trend Alternative IN HEUR	1 400,59	EUR	160,77	160,77		225 172,85
MONTLAKE-INVENOMIC US EQ. L/S (INS.PO.)	2 762,17	EUR	132,19	132,19		365 121,08
ORBIS SICAV - Japan Equity - EUR	6 978,23	EUR	58,48	58,48		408 086,83
PERSHING SQUARE HOLDINGS LTD	13 621,00	USD	36,40	34,42		468 882,23
SPDR Bloomberg Barclays EM LC Bond ETF	20 785,00	EUR	27,29	27,29		567 243,43
Sprott Physical Gold and Silver Trust (CEF)	50 550,00	USD	17,32	16,38		827 984,94
Stewart Investors Asia Pacific Leaders Fund	67 135,06	EUR	3,00	3,00		201 385,04
THIRD POINT OFFSHORE INVESTORS	15 935,00	USD	18,87	17,85		284 441,14
Vaneck Vectors Gold Miners UCITS ETF	11 485,00	EUR	27,79	27,79		319 168,15
iShares \$ Treasury Bond 20+yr UCITS ETF	134 598,00	EUR	3,12	3,12		420 255,34
iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Dist	114 799,00	EUR	4,73	4,73		543 125,55
iShares € Govt Bond Climate UCITS ETF	72 460,00	EUR	3,99	3,99		289 260,32
SUB-TOTAL						10 580 328,56



32	Fundos não harmonizados					
	FCR PORTUGAL OPPORTUNITIES FUND	45,00	EUR	5 000,00	5 000,00	225 000,00
	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
	SUB-TOTAL					541 943,00
4	Imobiliário					
42	U. P.'s de fundos de investimento imobiliário					
	CA Património Crescente	18 144,00	EUR	20,77	20,77	376 912,57
	SEB IMMOPORTFOLIO TARGET RETURN	1 485,00	EUR	3,98	3,98	5 910,30
	SEB Immoinvest	1 847,00	EUR	0,76	0,76	1 394,49
	SUB-TOTAL					384 217,36
5	Liquidez					
51	À vista					
512	Depósitos à ordem					
	BBVA - €		EUR			3 065,04
	Cx. Crédito Agrícola Mútuo		EUR			180,53
	GOLDEN CC EURO		EUR			367,56
	GOLDEN CONTA MARGEM EURO		EUR			107 761,99
	GOLDEN CONTA MARGEM USD		USD			-26 365,09
	GOLDEN FUTURO		USD			-14 743,88
	GOLDEN INDICO		EUR			66,82
	Millenium USD		USD			0,01
	Millenium bcp		EUR			297 159,44
	SUB-TOTAL					367 492,42
7	Operações com produtos derivados					
71	Em mercado regulamentado					
711	Futuros					
	E-Mini EURUSD - Dez 2023	25	USD	1,06224	1,004560368	0
	SUB-TOTAL					
712	Opções					
	Put SPY US 17/11/23 P430	62	USD	949,0000581	897,4693549	55643,1
9	Outros valores a regularizar					-28363,51
	TOTAL DE APLICAÇÕES					14705316,18
	TOTAL DO FUNDO					14676952,67

Lisboa, 30 de Setembro de 2023