

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA  
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR  
Composição da Carteira em 2021-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
<b>COMPOSIÇÃO DISCRIMINADA CARTEIRA</b>						
<b>VALORES MOBILIÁRIOS COTADOS</b>						
MERC. COT. OFICIAIS DE BOLSA VAL. PORT.						25 797
Ações						
EDP Renováveis	1 144	22.55	EUR	22.55		25 797
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					25 136	14 032 146
Títulos de Dívida Pública						
DBR 1.5% 02/2023	260 000	104.64%	EUR	104.64%	3 751	275 820
DBR 0.25% 02/2029	10 000	107.34%	EUR	107.34%	24	10 758
BKO 0% 09/2021	336 000	100.39%	EUR	100.39%		337 304
FRTR 4.25% 10/2023	600 000	113.66%	EUR	113.66%	6 916	688 846
FRTR 0.25% 11/26	940 000	104.84%	EUR	104.84%	438	985 896
SPGB 4.7% 07/2041	100 000	176.85%	EUR	176.85%	2 395	179 248
SPGB 3.45% 07/66	55 000	177.04%	EUR	177.04%	967	98 340
SPGB 0.45% 10/22	880 000	101.77%	EUR	101.77%	1 009	896 611
BTPS 4% 2/2037	150 000	142.94%	EUR	142.94%	3 000	217 412
BTPS 3.45% 03/48	315 000	144.61%	EUR	144.61%	4 593	460 112
RAGB 0.75% 10/26	395 000	107.82%	EUR	107.82%	844	426 749
IRISH 0% 10/22	60 000	101.13%	EUR	101.13%		60 678
CCTS Float 07/2023	200 000	100.95%	EUR	100.95%	16	201 920
						4 839 694
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
KFW 0% 04/2024	250 000	102.10%	EUR	102.10%		255 255
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	200 000	99.83%	EUR	99.83%		199 650
SAPGR Float 03/21	200 000	100.03%	EUR	100.03%		200 054
VW Float 12/21	200 000	100.29%	EUR	100.29%	51	200 625
PBBGR Float 07/28/23	200 000	100.72%	EUR	100.72%	8	201 438
DB Float 05/2022	300 000	100.31%	EUR	100.31%	184	301 117
BNP Float 09/22	100 000	101.16%	EUR	101.16%	36	101 193
SOCGEN Float 04/22	100 000	100.77%	EUR	100.77%	24	100 791
ACAFP Float 04/22	100 000	100.81%	EUR	100.81%	8	100 817
RENAUL Float 03/2022	200 000	100.15%	EUR	100.15%	34	200 332
GFCFP Float 06/22	200 000	100.22%	EUR	100.22%		200 436
RENAULT Float 11/24	50 000	98.16%	EUR	98.16%	6	49 084
CAFP Float 06/22	100 000	100.22%	EUR	100.22%	10	100 233
ACAFP Float 01/2022	100 000	100.47%	EUR	100.47%		100 465
CAFP Float 09/2023	100 000	100.37%	EUR	100.37%	14	100 379
LLOYDS Float 06/2024	100 000	101.06%	EUR	101.06%	28	101 090
HSBC Float 10/23	100 000	100.43%	EUR	100.43%		100 426
RBS Float 09/21	100 000	100.49%	EUR	100.49%	35	100 524
RBS Float 03/21	100 000	100.04%	EUR	100.04%	12	100 051
IBESM Float 02/24	200 000	100.63%	EUR	100.63%	58	201 322
AMSSM Float 03/22	200 000	99.60%	EUR	99.60%		199 206
SANTAN Float 03/23	200 000	100.79%	EUR	100.79%	41	201 627
ISPIM Float 04/22	100 000	100.69%	EUR	100.69%	14	100 707
BACRED Float 05/22	200 000	100.56%	EUR	100.56%	116	201 242
FCABNK Float 06/21	100 000	100.08%	EUR	100.08%		100 077
ISPIM Float 02/2021	100 000	99.92%	EUR	99.92%	98	100 022
WFC Float 01/22	100 000	100.39%	EUR	100.39%		100 393

## CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA  
 Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR  
 Composição da Carteira em 2021-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BAC Float 05/23	100 000	100.60%	EUR	100.60%	64	100 665
MS Float 11/22	200 000	100.40%	EUR	100.40%	85	200 891
GM Float 05/21	200 000	100.03%	EUR	100.03%	77	200 137
C Float 03/23	200 000	100.58%	EUR	100.58%		201 156
BAC FLOAT 04/24	100 000	100.63%	EUR	100.63%	3	100 636
T Float 09/23	200 000	101.20%	EUR	101.20%	107	202 499
GS Float 04/2023	100 000	100.19%	EUR	100.19%	0	100 191
DT Float 12/2022	200 000	100.47%	EUR	100.47%		200 940
BAYNGR Float 06/22	200 000	100.27%	EUR	100.27%	2	200 544
INTNED Float 09/23	100 000	101.56%	EUR	101.56%	36	101 591
ANNGR Float 12/2022	200 000	100.40%	EUR	100.40%		200 796
JYBC Float 12/22	100 000	100.79%	EUR	100.79%	12	100 803
KBCBB Float 11/22	100 000	100.66%	EUR	100.66%	4	100 667
ABIBB Float 04/24	200 000	100.46%	EUR	100.46%		200 912
DLTAS 2008-1 A	35 806	99.78%	EUR	99.78%		35 727
DHR Float 06/22	200 000	100.18%	EUR	100.18%		200 352
SUMIBK Float 06/22	200 000	100.51%	EUR	100.51%		201 016
MUFG Float 05/2023	200 000	100.48%	EUR	100.48%	8	200 964
BMO Float 03/22	100 000	100.48%	EUR	100.48%		100 480
GS Float 07/2022	75 000	101.01%	EUR	101.01%	6	75 765
GE FLOAT 5/21	200 000	100.05%	EUR	100.05%		200 104
						6 990 138
<b>Ações</b>						
BMW	483	70.01	EUR	70.01		33 815
DEUTSCHE BANK	3 219	8.37	EUR	8.37		26 940
SIEMENS	640	127.94	EUR	127.94		81 882
ALLIANZ	139	186.52	EUR	186.52		25 926
BASF	567	63.83	EUR	63.83		36 192
BAYER AG	1 169	49.92	EUR	49.92		58 351
RWE-RHEINISCH WEST..	271	35.46	EUR	35.46		9 610
ADIDAS- SALOMON AG	95	262.00	EUR	262.00		24 890
SAP SE	412	104.80	EUR	104.80		43 178
DEUTSCHE TELEKOM	2 985	14.70	EUR	14.70		43 880
DAIMLER CHRYSLER	352	58.12	EUR	58.12		20 458
INFINEON TECHNOLOGIE	232	33.13	EUR	33.13		7 685
DEUTSCHE POST	1 270	40.81	EUR	40.81		51 829
FRESENIUS SE&CO KGAA	466	36.77	EUR	36.77		17 135
SIEMENS HEALTHIN	450	46.28	EUR	46.28		20 826
Siemens Energy AG	320	30.58	EUR	30.58		9 786
DANONE	476	54.96	EUR	54.96		26 161
AXA-UAP	582	18.30	EUR	18.30		10 651
PERNOD RICARD	221	155.70	EUR	155.70		34 410
TOTAL SE	1 566	34.90	EUR	34.90		54 646
L OREAL	221	290.10	EUR	290.10		64 112
Kering	51	541.60	EUR	541.60		27 622
BNP	1 093	39.78	EUR	39.78		43 480
AIR LIQUIDE	281	135.00	EUR	135.00		37 935
SCHNEIDER	181	120.95	EUR	120.95		21 892
L.V.M.H.	187	498.30	EUR	498.30		93 182
MICHELIN	108	113.90	EUR	113.90		12 301
SAINT-GOBAIN	529	41.08	EUR	41.08		21 731



## CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA  
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR  
Composição da Carteira em 2021-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
<b>UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)</b>						
<b>OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL</b>						
						4 920 537
CXG IMOBILIARIO	182 714	4.03	EUR	4.03		735 862
CAIXA PRIVATE EQUITY	16 936	5.65	EUR	5.65		95 739
CXG INFRAESTRUTURAS	24 178	7.39	EUR	7.39		178 564
FUNDIESTAMO I	58	1 147.02	EUR	1 147.02		66 527
Fundimo	487 173	7.89	EUR	7.89		3 843 844
<b>OIC DOMICILIADOS NUM ESTADO-MEMBRO DA EU</b>						
						9 162 736
ALLIANZ EUOLD EQY G	246	3 254.30	EUR	3 254.30		800 558
SCHRODER ISF EURO EQ	53 139	47.09	EUR	47.09		2 502 066
ALLIANZ RCM EUR EQTY	625	2 307.49	EUR	2 307.49		1 442 181
EAST-US CB-CE HG	35 217	12.12	EUR	12.12		426 971
PGIS-CR BD-IN€HA	37 581	11.52	EUR	11.52		432 933
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	15 133	39.21	EUR	39.21		593 365
AB SCV I-EUZ EQ I	84 593	29.93	EUR	29.93		2 531 868
ISHARES EUR CORP.BON	3 053	141.76	EUR	141.76		432 793
						14 083 272
<b>LIQUIDEZ</b>						
<b>À VISTA</b>						
						1 463 280
<b>Depósitos à ordem</b>						
DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			876
DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			122
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			1 067 059
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			101 914
DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			1 488
DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			24
DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			324
DO CGD - USD 0.0000%			USD			5 255
DO SANTANDER US 0.0000%			USD			286 216
						1 463 280
						1 463 280
<b>OUTROS VALORES A REGULARIZAR</b>						
<b>VALORES ACTIVOS</b>						
						129 587
<b>VALORES PASSIVOS</b>						
						-49 862
						79 726
						30 200 186
<b>VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO</b>						
<b>RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS</b>						
<b>OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES</b>						
<b>Em mercado regulamentado</b>						
<b>Futuros</b>						
VGH1 EUR EUX 03/21	9	3 468.00	EUR	3 468.00		312 120
ESH1 S&P500 03/21	2	3 710.00	USD	3 057.27		305 727
						617 847
						617 847
						617 847

## CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA  
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR  
Composição da Carteira em 2021-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
<b>NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO</b>						4 562 475.98

**Valor da Unidade de Participação: € 6.6193**