

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
COMPOSIÇÃO DISCRIMINADA CARTEIRA						
VALORES MOBILIÁRIOS COTADOS						
MERC. COT. OFICIAIS DE BOLSA VAL. PORT.						28 344
Ações						
EDP Renováveis	2 362	12.00	EUR	12.00		28 344
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					138 270	79 230 503
Títulos de Dívida Pública						
DBR 1.5% 02/2023	700 000	106.77%	EUR	106.77%	10 097	757 487
DBR 1.25% 08/48	1 430 000	134.34%	EUR	134.34%	8 303	1 929 322
DBR 0.25% 02/2029	2 000 000	106.95%	EUR	106.95%	5 288	2 144 368
FRTR 4.25% 10/2023	2 150 000	118.31%	EUR	118.31%	24 716	2 568 381
FRTR 3% 04/2022	777 000	108.14%	EUR	108.14%	17 960	858 239
FRTR 0.25% 11/26	2 140 000	104.42%	EUR	104.42%	994	2 235 518
FRTR 2% 05/48	250 000	137.57%	EUR	137.57%	3 443	347 360
SPGB 1.95% 07/2030	100 000	117.09%	EUR	117.09%	991	118 079
SPGB 3.45% 07/66	480 000	168.29%	EUR	168.29%	8 416	816 184
SPGB 0.45% 10/22	2 969 000	102.35%	EUR	102.35%	3 395	3 042 196
BTPS 4% 2/2037	1 500 000	137.08%	EUR	137.08%	30 000	2 086 140
BTPS 3.45% 03/48	400 000	133.83%	EUR	133.83%	5 801	541 105
CCTS Float 07/2023	1 300 000	100.66%	EUR	100.66%	231	1 308 850
BOTS 0% 10/2020	1 008 000	100.24%	EUR	100.24%		1 010 399
NETHER 0.75% 07/28	1 065 000	109.90%	EUR	109.90%	4 387	1 174 854
RAGB 0.75% 10/26	1 065 000	107.91%	EUR	107.91%	2 270	1 151 490
IRISH 0% 10/22	400 000	101.43%	EUR	101.43%		405 708
						22 495 678
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
KFW 0% 04/2024	500 000	101.92%	EUR	101.92%		509 580
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	600 000	99.34%	EUR	99.34%	32	596 042
VW Float 07/21	200 000	100.07%	EUR	100.07%	10	200 146
SAPGR Float 03/21	300 000	100.16%	EUR	100.16%		300 480
VW Float 12/21	1 700 000	100.50%	EUR	100.50%	778	1 709 261
DB Float 12/2020	1 700 000	99.91%	EUR	99.91%	268	1 698 653
PBBGR Float 07/28/23	1 000 000	101.13%	EUR	101.13%	28	1 011 298
ACAFP Float 04/22	1 500 000	101.03%	EUR	101.03%	204	1 515 594
BNP Float 06/24	1 000 000	101.13%	EUR	101.13%	533	1 011 833
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.34%	EUR	100.34%	144	401 516
GFCFP Float 06/22	500 000	100.25%	EUR	100.25%		501 255
RENAULT Float 11/24	400 000	98.04%	EUR	98.04%	174	392 322
ALDFP Float 11/20	300 000	100.18%	EUR	100.18%	14	300 545
BNP Float 05/23	300 000	100.63%	EUR	100.63%	127	302 023
SOCGEN FLT.062%01/21	500 000	100.26%	EUR	100.26%		501 285
ACAFP Float 01/2022	600 000	100.75%	EUR	100.75%	39	604 557
CAFP Float 09/2023	1 900 000	100.15%	EUR	100.15%	692	1 903 599
HSBC Float 09/22	350 000	100.61%	EUR	100.61%	105	352 223
RBS Float 06/20	1 000 000	100.08%	EUR	100.08%	53	1 000 813
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	101.17%	EUR	101.17%	424	1 012 094
HSBC Float 10/23	1 500 000	100.23%	EUR	100.23%	131	1 503 626
CCE FLOAT 11/21	800 000	100.32%	EUR	100.32%		802 544
RBS Float 03/2020	200 000	100.02%	EUR	100.02%	1	200 035

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
RBS Float 03/21	500 000	100.31%	EUR	100.31%	172	501 732
IBESM Float 02/24	1 200 000	100.67%	EUR	100.67%	650	1 208 738
SANTAN Float 03/22	1 000 000	101.16%	EUR	101.16%	691	1 012 271
BBVASM Float 04/22	1 000 000	100.72%	EUR	100.72%	109	1 007 329
AMSSM Float 03/22	700 000	100.19%	EUR	100.19%	47	701 391
SANTAN Float 03/23	500 000	100.85%	EUR	100.85%	161	504 406
ISPIM Float 04/22	1 000 000	100.85%	EUR	100.85%	186	1 008 726
FCABNK Float 06/21	500 000	99.90%	EUR	99.90%		499 495
ISPIM Float 02/2021	500 000	100.67%	EUR	100.67%	609	503 944
GS Float 07/2021	200 000	101.16%	EUR	101.16%	17	202 329
MS Float 01/22	300 000	100.39%	EUR	100.39%	13	301 183
WFC Float 01/22	1 400 000	100.43%	EUR	100.43%	4	1 406 010
BAC Float 02/22	600 000	100.50%	EUR	100.50%	569	603 587
BAC Float 05/23	150 000	100.86%	EUR	100.86%	143	151 436
GM Float 05/21	800 000	100.20%	EUR	100.20%	513	802 121
BATSLN Float 08/21	500 000	100.15%	EUR	100.15%	105	500 860
F Float 12/22	300 000	96.91%	EUR	96.91%	11	290 729
C Float 03/23	500 000	100.32%	EUR	100.32%	57	501 672
GM Float 03/22	300 000	99.36%	EUR	99.36%	45	298 134
BAC FLOAT 04/24	800 000	100.74%	EUR	100.74%	35	805 923
T Float 09/23	1 500 000	101.44%	EUR	101.44%	1 106	1 522 631
FIS Float 05/2021	500 000	100.11%	EUR	100.11%		500 565
GS Float 04/2023	500 000	100.20%	EUR	100.20%	24	501 029
UBS Float 04/2021	500 000	100.45%	EUR	100.45%	14	502 254
SCANIA Float 03/21	200 000	100.10%	EUR	100.10%	13	200 217
DAIGR Float 05/22	500 000	99.88%	EUR	99.88%		499 405
MYL Float 05/20	200 000	99.97%	EUR	99.97%	35	199 983
BAYNGR Float 06/22	1 500 000	100.35%	EUR	100.35%	227	1 505 537
INTNED Float 09/23	600 000	101.47%	EUR	101.47%	320	609 128
INTNED Float 11/21	200 000	100.51%	EUR	100.51%	6	201 026
ABNANV Flt. 12/21	200 000	100.45%	EUR	100.45%		200 902
INTNED Float 04/22	200 000	100.51%	EUR	100.51%	2	201 026
ANNGR Float 12/2022	1 600 000	100.04%	EUR	100.04%	92	1 600 796
NYKRE Float 06/22	700 000	100.14%	EUR	100.14%	205	701 164
JYBC Float 06/20	400 000	100.07%	EUR	100.07%		400 260
NYKRE Flt. 01/24	300 000	101.12%	EUR	101.12%	29	303 393
SPOLNO Float 09/21	200 000	100.40%	EUR	100.40%	24	200 818
DNBNO Flt. 07/22	600 000	101.19%	EUR	101.19%	30	607 182
CBSBKF Float 03/21	400 000	100.17%	EUR	100.17%	63	400 741
KBCBB Float 11/22	1 400 000	100.69%	EUR	100.69%	376	1 410 078
ABIBB Float 04/24	1 200 000	99.92%	EUR	99.92%		1 199 016
DLTAS 2008-1 A	452 698	99.91%	EUR	99.91%	11	452 301
DHR Float 06/22	950 000	99.94%	EUR	99.94%		949 449
DE FLOAT 10/22	2 100 000	99.95%	EUR	99.95%		2 098 971
SUMIBK Float 06/22	1 500 000	100.37%	EUR	100.37%	108	1 505 613
CBAAU Float 03/2023	700 000	100.83%	EUR	100.83%	110	705 899
BMO Float 03/22	200 000	100.61%	EUR	100.61%	27	201 251
GS Float 07/2022	600 000	101.66%	EUR	101.66%	51	610 029
GS Float 29/05/2020	350 000	100.19%	EUR	100.19%	187	350 845
GE FLOAT 5/21	1 700 000	99.92%	EUR	99.92%		1 698 623
ISPIM Float 06/20	1 200 000	100.30%	EUR	100.30%	1 026	1 204 650

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
						53 878 543
Ações						
BMW	551	64.34	EUR	64.34		35 451
DEUTSCHE BANK	4 068	8.28	EUR	8.28		33 699
SIEMENS	758	111.64	EUR	111.64		84 623
ALLIANZ	177	215.85	EUR	215.85		38 205
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 554	10.24	EUR	10.24		15 913
BASF	423	61.07	EUR	61.07		25 833
BAYER AG	952	73.05	EUR	73.05		69 544
ADIDAS- SALOMON AG	112	285.80	EUR	285.80		32 010
SAP SE	682	117.82	EUR	117.82		80 353
DEUTSCHE TELEKOM	1 499	14.61	EUR	14.61		21 894
DAIMLER CHRYSLER	1 116	41.81	EUR	41.81		46 654
INFINEON TECHNOLOGIE	1 527	19.58	EUR	19.58		29 893
DEUTSCHE POST	1 498	31.58	EUR	31.58		47 299
TELEFONICA DEUTSCH H	6 509	2.74	EUR	2.74		17 861
FRESENIUS SE&CO KGAA	401	46.13	EUR	46.13		18 496
WIRECARD AG	213	133.20	EUR	133.20		28 372
COVESTRO AG	478	38.15	EUR	38.15		18 236
SIEMENS HEALTHIN	455	42.48	EUR	42.48		19 328
GEN DES EAUX/VIVENDI	470	24.76	EUR	24.76		11 637
DANONE	650	72.40	EUR	72.40		47 060
AXA-UAP	686	24.08	EUR	24.08		16 519
PERNOD RICARD	219	156.50	EUR	156.50		34 274
TOTAL SA	1 240	44.15	EUR	44.15		54 740
L OREAL	222	251.90	EUR	251.90		55 922
Kering	60	555.00	EUR	555.00		33 300
PEUGEOT CITROEN	1 373	18.61	EUR	18.61		25 552
BNP	1 376	48.05	EUR	48.05		66 110
AIR LIQUIDE	116	130.75	EUR	130.75		15 167
SCHNEIDER	214	90.52	EUR	90.52		19 371
L.V.M.H.	241	395.30	EUR	395.30		95 267
MICHELIN	126	105.00	EUR	105.00		13 230
SAINT-GOBAIN	623	34.24	EUR	34.24		21 328
BOUYGUES	418	35.73	EUR	35.73		14 935
EssilorLuxottica	208	134.25	EUR	134.25		27 924
ORANGE	223	12.81	EUR	12.81		2 856
GLE ENTREP. VINCI	446	100.20	EUR	100.20		44 689
SANOFI SYNHLABO	696	86.95	EUR	86.95		60 517
AIRBUS SE	533	133.24	EUR	133.24		71 017
CREDIT AGRICOLE SA	2 950	12.23	EUR	12.23		36 079
ILIAD SA	149	118.70	EUR	118.70		17 686
SAFRAN SA	129	145.95	EUR	145.95		18 828
HERMES INTERNACIONAL	22	676.60	EUR	676.60		14 885
TELEPERFORMANCE	57	226.80	EUR	226.80		12 928
RECKITT BENCKISER	219	62.81	GBP	74.77		16 374
ANGLO AMERICAN PLC	763	19.86	GBP	23.64		18 034
OCADO GROUP PLC	1 469	12.24	GBP	14.56		21 395
TELEFONICA	2 903	6.11	EUR	6.11		17 734
BCO SANTANDER C.HISP	4 527	3.55	EUR	3.55		16 089
IBERDROLA	3 324	9.87	EUR	9.87		32 808

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
REPSOL	1 704	12.47	EUR	12.47		21 240
FERROVIAL	458	28.66	EUR	28.66		13 126
INDITEX	1 222	30.37	EUR	30.37		37 112
TELECOM ITALIA	34 178	0.49	EUR	0.49		16 638
UNICREDITO ITALIANO	3 857	12.08	EUR	12.08		46 600
ENEL	4 661	7.86	EUR	7.86		36 612
ESSITY AKTIEBO-B	619	306.00	SEK	28.66		17 738
ING GROEP NV	5 363	9.83	EUR	9.83		52 691
ASML NA	397	254.25	EUR	254.25		100 937
AKZO NOBEL NV NLG20	379	85.30	EUR	85.30		32 329
DSM NV	340	110.30	EUR	110.30		37 502
FIAT CHRYSLER AUTOM	1 223	11.73	EUR	11.73		14 348
UNILEVER NV	1 783	52.70	EUR	52.70		93 964
SAMPO OYJ-A SHS	1 270	40.87	EUR	40.87		51 905
Neste Oyj	1 115	35.88	EUR	35.88		40 006
KBC BANKVERZEKERING	757	66.26	EUR	66.26		50 159
ERST BK DER OEST.SPA	1 380	33.16	EUR	33.16		45 761
CRH ORD	593	33.92	EUR	33.92		20 115
						2 346 702
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					1 831	4 679 892
Obrigações diversas						
F Float 12/21	1 000 000	98.58%	EUR	98.58%		985 830
F Float 05/21	250 000	99.50%	EUR	99.50%	18	248 763
UBS Float 09/22	1 500 000	100.59%	EUR	100.59%	532	1 509 382
AGM Float 11/20	100 000	100.03%	EUR	100.03%		100 026
TACHEM Float 11/22	700 000	102.02%	EUR	102.02%	969	715 088
TACHEM Float 11/20	1 100 000	100.26%	EUR	100.26%	312	1 103 183
						4 662 272
Ações						
ZURICH ALLIED AG	47	400.70	CHF	374.89		17 620
						83 938 739
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						7 286 934
CXG IMOBILIARIO	710 909	4.02	EUR	4.02		2 857 925
CAIXA PRIVATE EQUITY	40 509	5.54	EUR	5.54		224 392
CXG INFRAESTRUTURAS	77 407	7.99	EUR	7.99		618 288
Fundimo	466 982	7.68	EUR	7.68		3 586 328
OIC DOMICILIADOS NUM ESTADO-MEMBRO DA EU						14 256 788
ALLIANZ EUOLD EQY G	357	2 909.86	EUR	2 909.86		1 038 820
SCHRODER ISF EURO EQ	67 654	46.54	EUR	46.54		3 148 867
JAN HND UK ABS RET	47 051	7.22	EUR	7.22		339 911
SCH EUROP ALPHA ABS	2 182	95.45	EUR	95.45		208 280
LYXOR EPSILON GLOB E	1 423	137.65	EUR	137.65		195 873
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	2 057.13	EUR	2 057.13		2 151 758
AMUNDI CASH INST SRI	9	218 083.50	EUR	218 083.50		1 962 752
LFIS-VIS PR-M€A	574	1 046.20	EUR	1 046.20		600 519
MLIS PSAM GL EV UC A	1 951	140.67	EUR	140.67		274 432
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	15 052	38.45	EUR	38.45		578 749
AB SCV I-EUZ EQ I	102 318	31.18	EUR	31.18		3 190 275
DNCA INV-MIUR-IE	0	113.94	EUR	113.94		0

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
XUS TREASURY €	4 697	120.62	EUR	120.62		566 552
OIC DOMICL. EM ESTADOS NÃO MEMBROS DA EU						1 171 937
TISHMAN ESOF	91 579	0.05	EUR	0.05		4 706
ISHARES TREASURY B	48 702	26.56	USD	23.97		1 167 231
						22 715 658

OUTROS ACTIVOS

Imóveis						
R Rodrigo Fonseca	5	452 800.00	EUR	452 800.00		2 264 000
REPUBLICA 35- R/C	8	626 250.00	EUR	626 250.00		5 010 000
						7 274 000
						7 274 000

LIQUIDEZ

À VISTA						6 243 162
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			278
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			201
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			5 737 329
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			125 336
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			5 761
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			91
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			661
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			280 141
DO SANTANDER US 0.0000%			USD			93 364
						6 243 162
						6 243 162

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

VALORES ACTIVOS						141 735
VALORES PASSIVOS						-164 332
						-22 597
						120 148 963

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS
OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES

Em mercado regulamentado						
Futuros						
VGH0 EUR EUX 03/20	32	3 634.00	EUR	3 634.00		1 162 880
ESH0 S&P500 03/20	-8	3 237.00	USD	2 920.95		-1 168 381
						-5 501
						-5 501
						-5 501

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO 8 849 683.39

Valor da Unidade de Participação: € 13.5766