

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2021-02-28

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.						32 254
Ações						
EDP Renováveis	1 782	18.10	EUR	18.10		32 254
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					106 683	78 019 128
Títulos de Dívida Pública						
DBR 1.5% 02/2023	982 000	104.31%	EUR	104.31%	565	1 024 928
BKO 0% 09/2021	1 000 000	100.31%	EUR	100.31%		1 003 050
FRTR 4.25% 10/2023	300 000	113.05%	EUR	113.05%	4 436	343 598
FRTR 3% 04/2022	1 700 000	104.17%	EUR	104.17%	43 315	1 814 205
FRTR 0.25% 11/26	4 740 000	103.65%	EUR	103.65%	3 117	4 915 985
SPGB 1.95% 07/2030	300 000	115.11%	EUR	115.11%	3 430	348 760
SPGB 3.45% 07/66	480 000	160.63%	EUR	160.63%	9 709	780 738
SPGB 0.45% 10/22	1 800 000	101.53%	EUR	101.53%	2 685	1 830 153
BTPS 4% 2/2037	300 000	140.50%	EUR	140.50%	928	422 431
BTPS 2% 12/2025	2 100 000	108.96%	EUR	108.96%	10 385	2 298 566
BTPS 3.45% 03/48	1 136 000	141.00%	EUR	141.00%	19 596	1 621 401
RAGB 0% 07/2023	1 165 000	101.36%	EUR	101.36%		1 180 821
IRISH 0% 10/22	400 000	100.93%	EUR	100.93%		403 720
CCTS Float 07/2023	1 300 000	100.97%	EUR	100.97%	281	1 312 826
						19 301 182
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
KFW 0% 04/2024	500 000	101.73%	EUR	101.73%		508 630
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	600 000	99.93%	EUR	99.93%		599 580
VW Float 07/21	200 000	100.09%	EUR	100.09%		200 170
VW Float 12/21	1 700 000	100.32%	EUR	100.32%	658	1 706 013
PBBGR Float 07/28/23	1 000 000	100.95%	EUR	100.95%	321	1 009 861
DB Float 05/2022	2 400 000	100.34%	EUR	100.34%	219	2 408 427
ACAFP Float 04/22	1 500 000	100.76%	EUR	100.76%	412	1 511 857
SOCGEN Float 05/24	500 000	101.18%	EUR	101.18%	25	505 925
BNP Float 06/24	1 000 000	101.13%	EUR	101.13%	520	1 011 840
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.22%	EUR	100.22%	106	400 994
GFCFP Float 06/22	500 000	100.25%	EUR	100.25%		501 255
RENAULT Float 11/24	400 000	98.85%	EUR	98.85%	8	395 388
BNP Float 05/23	300 000	100.80%	EUR	100.80%	4	302 401
ACAFP Float 01/2022	600 000	100.44%	EUR	100.44%		602 658
CAFP Float 09/2023	1 900 000	100.44%	EUR	100.44%	423	1 908 802
HSBC Float 09/22	100 000	100.32%	EUR	100.32%	28	100 350
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	101.05%	EUR	101.05%	465	1 010 965
HSBC Float 10/23	1 500 000	100.36%	EUR	100.36%		1 505 445
CCE FLOAT 11/21	800 000	100.17%	EUR	100.17%		801 344
RBS Float 09/21	1 200 000	100.44%	EUR	100.44%	754	1 206 010
IBESM Float 02/24	1 200 000	100.77%	EUR	100.77%	30	1 209 318
SANTAN Float 03/22	1 000 000	100.90%	EUR	100.90%	931	1 009 931
BBVASM Float 04/22	1 000 000	100.52%	EUR	100.52%	67	1 005 307
AMSSM Float 03/22	700 000	99.91%	EUR	99.91%		699 363
SANTAN Float 03/23	500 000	100.82%	EUR	100.82%	183	504 278
ISPIM Float 04/22	1 000 000	100.67%	EUR	100.67%	453	1 007 143

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2021-02-28

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BACRED Float 05/22	1 000 000	100.57%	EUR	100.57%	79	1 005 749
FCABNK Float 06/21	500 000	100.04%	EUR	100.04%		500 220
GS Float 07/2021	200 000	100.38%	EUR	100.38%	84	200 844
WFC Float 01/22	1 400 000	100.38%	EUR	100.38%		1 405 292
BAC Float 05/23	150 000	100.57%	EUR	100.57%	25	150 883
MS Float 11/22	1 200 000	100.34%	EUR	100.34%	110	1 204 166
GM Float 05/21	800 000	100.03%	EUR	100.03%	61	800 317
BATSLN Float 08/21	500 000	100.10%	EUR	100.10%		500 515
F Float 12/22	300 000	97.92%	EUR	97.92%		293 748
C Float 03/23	1 650 000	100.53%	EUR	100.53%		1 658 762
GM Float 03/22	300 000	99.93%	EUR	99.93%	5	299 807
BAC FLOAT 04/24	1 400 000	100.63%	EUR	100.63%	214	1 408 978
T Float 09/23	1 500 000	101.16%	EUR	101.16%	1 182	1 518 612
FIS Float 05/2021	500 000	100.05%	EUR	100.05%		500 265
GS Float 04/2023	500 000	100.19%	EUR	100.19%	1	500 946
SCANIA Float 03/21	200 000	100.01%	EUR	100.01%		200 022
DAIGR Float 05/22	500 000	100.21%	EUR	100.21%		501 035
BAYNGR Float 06/22	1 500 000	100.30%	EUR	100.30%	24	1 504 569
INTNED Float 09/23	600 000	101.53%	EUR	101.53%	361	609 541
INTNED Float 11/21	200 000	100.36%	EUR	100.36%		200 726
ABNANV Flt. 12/21	200 000	100.37%	EUR	100.37%		200 742
INTNED Float 04/22	200 000	100.52%	EUR	100.52%		201 042
ANNGR Float 12/2022	1 600 000	100.40%	EUR	100.40%		1 606 368
NYKRE Float 06/22	700 000	100.45%	EUR	100.45%	76	703 205
NYKRE Flt. 01/24	300 000	100.58%	EUR	100.58%		301 752
SPOLNO Float 09/21	200 000	100.23%	EUR	100.23%		200 458
DNBNO Flt. 07/22	600 000	100.96%	EUR	100.96%	121	605 893
SBBBSS Float 2/2023	300 000	100.06%	EUR	100.06%	25	300 196
KBCBB Float 11/22	1 600 000	100.64%	EUR	100.64%	2	1 610 178
ABIBB Float 04/24	1 600 000	100.40%	EUR	100.40%		1 606 368
DLTAS 2008-1 A	311 344	99.85%	EUR	99.85%	0	310 877
DHR Float 06/22	950 000	100.19%	EUR	100.19%		951 796
DE FLOAT 10/22	2 100 000	100.40%	EUR	100.40%		2 108 421
SUMIBK Float 06/22	1 500 000	100.48%	EUR	100.48%		1 507 230
MUFG Float 05/2023	1 400 000	100.54%	EUR	100.54%	1	1 407 547
CBAAU Float 03/2023	700 000	100.82%	EUR	100.82%		705 754
BMO Float 03/22	200 000	100.43%	EUR	100.43%		200 866
GS Float 07/2022	600 000	101.00%	EUR	101.00%	261	606 243
GE FLOAT 5/21	1 700 000	100.04%	EUR	100.04%		1 700 714
						54 925 268
Ações						
BMW	754	71.50	EUR	71.50		53 911
DEUTSCHE BANK	5 199	10.21	EUR	10.21		53 103
SIEMENS	1 037	127.98	EUR	127.98		132 715
ALLIANZ	225	199.80	EUR	199.80		44 955
BASF	910	67.73	EUR	67.73		61 634
BAYER AG	1 888	50.12	EUR	50.12		94 627
RWE-RHEINISCH WEST	438	31.34	EUR	31.34		13 727
ADIDAS- SALOMON AG	153	288.90	EUR	288.90		44 202
SAP SE	663	102.06	EUR	102.06		67 666
DEUTSCHE TELEKOM	4 801	15.03	EUR	15.03		72 159

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2021-02-28

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
DAIMLER CHRYSLER	528	66.25	EUR	66.25		34 980
INFINEON TECHNOLOGIE	401	36.00	EUR	36.00		14 436
DEUTSCHE POST	2 050	41.06	EUR	41.06		84 173
FRESENIUS SE&CO KGAA	753	35.44	EUR	35.44		26 686
SIEMENS HEALTHIN	727	45.83	EUR	45.83		33 318
Siemens Energy AG	519	31.25	EUR	31.25		16 219
DANONE	767	56.46	EUR	56.46		43 305
AXA-UAP	939	20.80	EUR	20.80		19 531
PERNOD RICARD	355	157.35	EUR	157.35		55 859
TOTAL SE	2 531	38.38	EUR	38.38		97 127
L OREAL	355	302.80	EUR	302.80		107 494
Kering	82	524.90	EUR	524.90		43 042
BNP	1 766	49.28	EUR	49.28		87 020
AIR LIQUIDE	453	124.70	EUR	124.70		56 489
SCHNEIDER	293	122.85	EUR	122.85		35 995
L.V.M.H.	317	525.00	EUR	525.00		166 425
MICHELIN	173	119.75	EUR	119.75		20 717
SAINT-GOBAIN	853	44.42	EUR	44.42		37 890
BOUYGUES	572	33.56	EUR	33.56		19 196
EssilorLuxottica	285	135.00	EUR	135.00		38 475
GLE ENTREP. VINCI	610	86.04	EUR	86.04		52 484
ST MICROELECTRON	1 558	31.99	EUR	31.99		49 840
DASSAULT SYSTEMES	208	171.90	EUR	171.90		35 755
SANOFI SYNHLABO	1 061	75.80	EUR	75.80		80 424
AIRBUS SE	729	95.91	EUR	95.91		69 918
CREDIT AGRICOLE SA	3 749	11.62	EUR	11.62		43 545
ILIAD SA	204	146.60	EUR	146.60		29 906
SAFRAN SA	177	113.25	EUR	113.25		20 045
HERMES INTERNACIONAL	30	923.20	EUR	923.20		27 696
TELEPERFORMANCE	78	293.10	EUR	293.10		22 862
RECKITT BENCKISER	369	60.00	GBP	69.20		25 533
ANGLO AMERICAN PLC	826	27.73	GBP	31.97		26 411
OCADO GROUP PLC	1 134	22.00	GBP	25.37		28 772
TELEFONICA	3 973	3.53	EUR	3.53		14 009
BCO SANTANDER C.HISP	24 722	2.90	EUR	2.90		71 632
IBERDROLA	5 991	10.43	EUR	10.43		62 456
REPSOL	1 620	10.42	EUR	10.42		16 872
FERROVIAL	627	20.64	EUR	20.64		12 941
INDITEX	1 672	27.31	EUR	27.31		45 662
TELECOM ITALIA	46 811	0.39	EUR	0.39		18 392
UNICREDITO ITALIANO	4 902	8.54	EUR	8.54		41 863
ENI SPA	1 345	9.48	EUR	9.48		12 753
ENEL	8 341	7.84	EUR	7.84		65 427
ESSITY AKTIEBO-B	847	253.80	SEK	24.91		21 101
ASML NA	514	465.35	EUR	465.35		239 190
AKZO NOBEL NV NLG20	408	85.56	EUR	85.56		34 908
DSM NV	278	136.55	EUR	136.55		37 961
STELLANTIS NV	4 643	13.43	EUR	13.43		62 374
Prosus NV	523	98.06	EUR	98.06		51 285
Adyen NV	10	1 916.00	EUR	1 916.00		19 160
SAMPO OYJ-A SHS	1 645	36.87	EUR	36.87		60 651
Neste Oyj	445	54.46	EUR	54.46		24 235

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2021-02-28

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
KBC BANKVERZEKERING	970	59.62	EUR	59.62		57 831
ANHEUSER-BUSCH INB	966	47.46	EUR	47.46		45 846
ERST BK DER OEST.SPA	1 766	27.29	EUR	27.29		48 194
CRH ORD	811	35.80	EUR	35.80		29 034
						3 284 048
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					900	5 101 459
Títulos de Dívida Pública						
KOREA 0% 09/2025	200 000	100.66%	EUR	100.66%		201 324
Obrigações diversas						
F Float 12/21	1 000 000	99.54%	EUR	99.54%		995 410
F Float 05/21	250 000	99.77%	EUR	99.77%		249 433
UBS Float 09/22	1 500 000	100.31%	EUR	100.31%	464	1 505 054
CS Float 01/2026	500 000	101.15%	EUR	101.15%	263	505 993
TACHEM Float 11/22	1 600 000	101.40%	EUR	101.40%	173	1 622 621
						4 878 510
Ações						
ZURICH ALLIED AG	64	371.50	CHF	337.88		21 625
						83 152 841
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						12 111 154
CXG IMOBILIARIO	710 909	4.06	EUR	4.06		2 887 428
CAIXA PRIVATE EQUITY	40 509	5.81	EUR	5.81		235 382
CXG INFRAESTRUTURAS	79 838	7.35	EUR	7.35		587 065
Fundimo	1 061 545	7.91	EUR	7.91		8 401 279
OIC DOMICILIADOS NUM ESTADO-MEMBRO DA EU						12 747 261
ALLIANZ EUOLD EQY G	227	3 279.88	EUR	3 279.88		744 533
SCHRODER ISF EURO EQ	65 998	48.65	EUR	48.65		3 210 585
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	2 326.16	EUR	2 326.16		2 433 163
EAST-US CB-CE HG	76 489	11.82	EUR	11.82		903 947
PGIS-CR BD-IN€HA	81 624	11.22	EUR	11.22		915 821
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	33 565	39.56	EUR	39.56		1 327 831
AB SCV I-EUZ EQ I	105 638	30.40	EUR	30.40		3 211 380
OIC DOMICI. EM ESTADOS NÃO MEMBROS DA EU						1 149
TISHMAN ESOE	91 579	0.01	EUR	0.01		1 149
						24 859 564
OUTROS ACTIVOS						
Imóveis						
R Rodrigo Fonseca	5	461 000.00	EUR	461 000.00		2 305 000
REPUBLICA 35- R/C	8	625 075.00	EUR	625 075.00		5 000 600
						7 305 600
						7 305 600
LIQUIDEZ						
À VISTA						3 854 366
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			574
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			46
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			3 011 266
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			297 749
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			1 938

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2021-02-28

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			68
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			376
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			3 856
DO SANTANDER US 0.0000%			USD			538 494
						3 854 366
						3 854 366

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

VALORES ACTIVOS						101 228
VALORES PASSIVOS						-252 211
						-150 983
						119 021 387

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES

Em mercado regulamentado						
Futuros						
VGH1 EUR EUX 03/21	17	3 653.00	EUR	3 653.00		621 010
ESH1 S&P500 03/21	4	3 853.50	USD	3 186.82		637 364
						1 258 374
						1 258 374
						1 258 374

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO 8 634 956.83

Valor da Unidade de Participação: € 13.7837