

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-03-31

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.						25 935
Ações						
EDP Renováveis	2 362	10.98	EUR	10.98		25 935
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					128 981	74 433 944
Títulos de Dívida Pública						
DBR 2.5% 01/2021	2 970 000	102.43%	EUR	102.43%	17 852	3 059 964
DBR 1.25% 08/48	100 000	135.32%	EUR	135.32%	786	136 105
DBR 0.25% 02/2029	2 500 000	107.07%	EUR	107.07%	786	2 677 586
FRTR 4.25% 10/2023	2 150 000	117.10%	EUR	117.10%	39 696	2 557 367
FRTR 3% 04/2022	442 000	107.41%	EUR	107.41%	12 390	487 156
FRTR 0.25% 11/26	2 140 000	103.03%	EUR	103.03%	1 871	2 206 756
FRTR 2% 05/48	850 000	131.81%	EUR	131.81%	14 492	1 134 894
SPGB 1.95% 07/2030	100 000	112.52%	EUR	112.52%	1 311	113 831
SPGB 3.45% 07/66	480 000	153.48%	EUR	153.48%	11 130	747 844
SPGB 0.45% 10/22	2 969 000	101.39%	EUR	101.39%	5 585	3 015 825
BTPS 4% 2/2037	1 500 000	127.17%	EUR	127.17%	9 890	1 917 455
BTPS 3.45% 03/48	400 000	121.03%	EUR	121.03%	1 163	485 283
CCTS Float 07/2023	1 300 000	99.06%	EUR	99.06%	1 045	1 288 851
IRISH 0% 10/22	400 000	100.97%	EUR	100.97%		403 880
						20 232 795
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
KFW 0% 04/2024	500 000	101.02%	EUR	101.02%		505 120
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	600 000	92.94%	EUR	92.94%	99	557 751
VW Float 07/21	200 000	98.33%	EUR	98.33%	34	196 690
SAPGR Float 03/21	300 000	99.67%	EUR	99.67%		298 998
VW Float 12/21	1 700 000	98.07%	EUR	98.07%	251	1 667 424
DB Float 12/2020	1 700 000	98.65%	EUR	98.65%	34	1 677 152
PBBGR Float 07/28/23	1 000 000	97.72%	EUR	97.72%	859	978 039
ACAFP Float 04/22	1 500 000	96.62%	EUR	96.62%	1 221	1 450 521
BNP Float 06/24	1 000 000	92.73%	EUR	92.73%	180	927 500
RENAUL Float 03/2022	400 000	96.71%	EUR	96.71%	32	386 868
GFCFP Float 06/22	500 000	99.25%	EUR	99.25%	1	496 231
RENAULT Float 11/24	400 000	87.23%	EUR	87.23%	112	349 020
ALDFP Float 11/20	200 000	99.51%	EUR	99.51%	2	199 022
BNP Float 05/23	300 000	94.44%	EUR	94.44%	65	283 373
SOCGEN FLT.062%01/21	500 000	99.22%	EUR	99.22%		496 110
ACAFP Float 01/2022	600 000	98.07%	EUR	98.07%	196	588 616
CAFP Float 09/2023	1 900 000	97.23%	EUR	97.23%	177	1 847 623
HSBC Float 09/22	350 000	95.85%	EUR	95.85%	16	335 481
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	92.80%	EUR	92.80%	97	928 097
HSBC Float 10/23	1 500 000	93.05%	EUR	93.05%	434	1 396 184
CCE FLOAT 11/21	800 000	99.73%	EUR	99.73%		797 832
RBS Float 09/21	1 200 000	98.33%	EUR	98.33%	89	1 180 049
RBS Float 03/21	500 000	98.83%	EUR	98.83%	73	494 208
IBESM Float 02/24	1 200 000	98.58%	EUR	98.58%	365	1 183 271
SANTAN Float 03/22	1 000 000	98.03%	EUR	98.03%	157	980 417
BBVASM Float 04/22	1 000 000	97.67%	EUR	97.67%	454	977 104

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
AMSSM Float 03/22	700 000	97.59%	EUR	97.59%	11	683 127
SANTAN Float 03/23	500 000	94.80%	EUR	94.80%	11	474 026
ISPIM Float 04/22	1 000 000	96.81%	EUR	96.81%	1 114	969 184
FCABNK Float 06/21	500 000	98.56%	EUR	98.56%		492 810
ISPIM Float 02/2021	500 000	99.05%	EUR	99.05%	309	495 539
GS Float 07/2021	200 000	97.91%	EUR	97.91%	222	196 038
MS Float 01/22	300 000	97.12%	EUR	97.12%	170	291 530
WFC Float 01/22	1 400 000	96.35%	EUR	96.35%	240	1 349 168
BAC Float 02/22	600 000	97.17%	EUR	97.17%	360	583 380
BAC Float 05/23	150 000	94.97%	EUR	94.97%	92	142 542
GM Float 05/21	800 000	96.44%	EUR	96.44%	318	771 846
BATSLN Float 08/21	500 000	98.84%	EUR	98.84%	54	494 249
F Float 12/22	300 000	77.50%	EUR	77.50%		232 485
C Float 03/23	1 150 000	93.63%	EUR	93.63%	31	1 076 764
GM Float 03/22	300 000	93.70%	EUR	93.70%	9	281 103
BAC FLOAT 04/24	800 000	92.68%	EUR	92.68%	454	741 926
T Float 09/23	1 500 000	99.20%	EUR	99.20%	485	1 488 525
FIS Float 05/2021	500 000	98.92%	EUR	98.92%		494 615
GS Float 04/2023	500 000	93.28%	EUR	93.28%	157	466 572
SCANIA Float 03/21	200 000	99.56%	EUR	99.56%	2	199 118
DAIGR Float 05/22	500 000	97.82%	EUR	97.82%		489 100
MYL Float 05/20	200 000	99.97%	EUR	99.97%	19	199 967
BAYNGR Float 06/22	1 500 000	98.54%	EUR	98.54%	44	1 478 099
INTNED Float 09/23	600 000	94.20%	EUR	94.20%	88	565 276
INTNED Float 11/21	200 000	98.19%	EUR	98.19%	1	196 373
ABNANV Flt. 12/21	200 000	98.01%	EUR	98.01%		196 014
INTNED Float 04/22	200 000	97.47%	EUR	97.47%	7	194 949
ANNGR Float 12/2022	1 600 000	98.00%	EUR	98.00%	23	1 568 087
NYKRE Float 06/22	700 000	96.72%	EUR	96.72%	85	677 097
JYBC Float 06/20	400 000	99.75%	EUR	99.75%		399 012
NYKRE Flt. 01/24	300 000	100.44%	EUR	100.44%	85	301 409
SPOLNO Float 09/21	200 000	98.02%	EUR	98.02%	4	196 038
DNBNO Flt. 07/22	600 000	97.67%	EUR	97.67%	394	586 414
CBSBKF Float 03/21	400 000	98.87%	EUR	98.87%	8	395 484
KBCBB Float 11/22	1 400 000	95.43%	EUR	95.43%	201	1 336 151
ABIBB Float 04/24	1 200 000	95.52%	EUR	95.52%		1 146 204
DLTAS 2008-1 A	430 957	99.80%	EUR	99.80%	8	430 103
DHR Float 06/22	950 000	97.97%	EUR	97.97%		930 715
DE FLOAT 10/22	2 100 000	98.37%	EUR	98.37%		2 065 749
SUMIBK Float 06/22	1 500 000	95.86%	EUR	95.86%		1 437 915
CBAAU Float 03/2023	700 000	96.12%	EUR	96.12%	14	672 868
BMO Float 03/22	200 000	97.66%	EUR	97.66%	1	195 319
GS Float 07/2022	600 000	96.61%	EUR	96.61%	665	580 301
GS Float 29/05/2020	200 000	99.77%	EUR	99.77%	51	199 595
GE FLOAT 5/21	1 700 000	98.79%	EUR	98.79%		1 679 345
ISPIM Float 06/20	1 200 000	99.87%	EUR	99.87%	299	1 198 727
						51 914 439
Ações						
BMW	551	47.12	EUR	47.12		25 960
DEUTSCHE BANK	4 068	5.97	EUR	5.97		24 282
SIEMENS	758	77.47	EUR	77.47		58 722
ALLIANZ	177	156.88	EUR	156.88		27 768

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 554	9.44	EUR	9.44		14 671
BASF	423	43.15	EUR	43.15		18 250
BAYER AG	952	52.85	EUR	52.85		50 313
ADIDAS- SALOMON AG	112	205.90	EUR	205.90		23 061
SAP SE	682	102.80	EUR	102.80		70 110
DEUTSCHE TELEKOM	3 509	11.81	EUR	11.81		41 455
DAIMLER CHRYSLER	1 116	27.52	EUR	27.52		30 712
INFINEON TECHNOLOGIE	1 527	13.43	EUR	13.43		20 508
DEUTSCHE POST	1 498	24.78	EUR	24.78		37 113
FRESENIUS SE&CO KGAA	401	33.93	EUR	33.93		13 606
WIRECARD AG	213	104.65	EUR	104.65		22 290
COVESTRO AG	478	27.87	EUR	27.87		13 322
SIEMENS HEALTHIN	455	36.05	EUR	36.05		16 400
DANONE	650	58.64	EUR	58.64		38 116
AXA-UAP	686	15.79	EUR	15.79		10 831
PERNOD RICARD	219	129.45	EUR	129.45		28 350
TOTAL SA	1 850	35.39	EUR	35.39		65 472
L OREAL	222	238.90	EUR	238.90		53 036
Kering	60	475.90	EUR	475.90		28 554
PEUGEOT CITROEN	1 373	12.17	EUR	12.17		16 703
BNP	1 376	27.51	EUR	27.51		37 854
AIR LIQUIDE	116	116.65	EUR	116.65		13 531
SCHNEIDER	214	78.58	EUR	78.58		16 816
L.V.M.H.	241	338.45	EUR	338.45		81 566
MICHELIN	126	81.06	EUR	81.06		10 214
SAINT-GOBAIN	623	22.17	EUR	22.17		13 809
BOUYGUES	418	26.72	EUR	26.72		11 169
EssilorLuxottica	208	98.28	EUR	98.28		20 442
GLE ENTREP. VINCI	446	75.40	EUR	75.40		33 628
SANOFI SYNHLABO	696	80.14	EUR	80.14		55 777
AIRBUS SE	533	59.34	EUR	59.34		31 628
CREDIT AGRICOLE SA	2 950	6.69	EUR	6.69		19 736
ILIAD SA	149	123.65	EUR	123.65		18 424
SAFRAN SA	129	80.14	EUR	80.14		10 338
HERMES INTERNACIONAL	22	628.80	EUR	628.80		13 834
TELEPERFORMANCE	57	189.80	EUR	189.80		10 819
RECKITT BENCKISER	219	61.50	GBP	69.51		15 222
ANGLO AMERICAN PLC	763	14.16	GBP	16.01		12 214
OCADO GROUP PLC	1 469	12.20	GBP	13.79		20 255
TELEFONICA	2 903	4.17	EUR	4.17		12 116
BCO SANTANDER C.HISP	18 827	2.22	EUR	2.22		41 758
IBERDROLA	3 324	8.98	EUR	8.98		29 863
REPSOL	1 704	8.33	EUR	8.33		14 198
FERROVIAL	458	21.87	EUR	21.87		10 016
INDITEX	1 222	23.66	EUR	23.66		28 913
TELECOM ITALIA	34 178	0.37	EUR	0.37		12 728
UNICREDITO ITALIANO	3 857	7.15	EUR	7.15		27 566
ENEL	4 661	6.34	EUR	6.34		29 546
ESSITY AKTIEBO-B	619	306.00	SEK	28.01		17 340
ASML NA	397	242.45	EUR	242.45		96 253
AKZO NOBEL NV NLG20	379	60.01	EUR	60.01		22 744
DSM NV	340	103.50	EUR	103.50		35 190

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
FIAT CHRYSLER AUTOM	1 223	6.57	EUR	6.57		8 038
UNILEVER NV	1 783	44.81	EUR	44.81		79 887
SAMPO OYJ-A SHS	1 270	26.62	EUR	26.62		33 807
Neste Oyj	483	30.85	EUR	30.85		14 901
KBC BANKVERZEKERING	757	42.02	EUR	42.02		31 809
ERST BK DER OEST.SPA	1 380	16.89	EUR	16.89		23 301
CRH ORD	593	24.85	EUR	24.85		14 736
						1 781 590
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					694	3 260 076
Obrigações diversas						
F Float 12/21	1 000 000	87.02%	EUR	87.02%		870 200
F Float 05/21	250 000	93.69%	EUR	93.69%	6	234 218
UBS Float 09/22	1 500 000	96.36%	EUR	96.36%	146	1 445 471
TACHEM Float 11/22	700 000	99.20%	EUR	99.20%	543	694 971
						3 244 860
Ações						
ZURICH ALLIED AG	47	343.40	CHF	323.75		15 216
						77 719 955
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						11 759 160
CXG IMOBILIARIO	710 909	4.03	EUR	4.03		2 865 959
CAIXA PRIVATE EQUITY	40 509	5.64	EUR	5.64		228 471
CXG INFRAESTRUTURAS	79 838	7.79	EUR	7.79		622 178
Fundimo	1 034 798	7.77	EUR	7.77		8 042 554
OIC DOMICILIADOS NUM ESTADO-MEMBRO DA EU						13 074 627
ALLIANZ EUOLD EQY G	789	2 322.27	EUR	2 322.27		1 832 271
SCHRODER ISF EURO EQ	98 317	34.50	EUR	34.50		3 391 828
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	1 642.55	EUR	1 642.55		1 718 107
AMUNDI CASH INST SRI	3	217 931.80	EUR	217 931.80		653 795
EAST-US CB-CE HG	50 780	10.86	EUR	10.86		551 217
PGIS-CR BD-IN€HA	53 173	10.22	EUR	10.22		543 428
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	33 565	32.68	EUR	32.68		1 096 904
AB SCV I-EUZ EQ I	151 828	21.65	EUR	21.65		3 287 076
OIC DOMICI. EM ESTADOS NÃO MEMBROS DA EU						2 157
TISHMAN ESOF	91 579	0.02	EUR	0.02		2 157
						24 835 945
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						3 730 588
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			280
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			67
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			3 434 203
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			151 075

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			949
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			81
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			51
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			857
DO SANTANDER US 0.0000%			USD			143 025
						3 730 588
						3 730 588

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

VALORES ACTIVOS						181 182
VALORES PASSIVOS						-377 203
						-196 021
						113 364 467

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES

Em mercado regulamentado						
Futuros						
VGM0 EUR EUX 06/20	35	2 724.00	EUR	2 724.00		953 400

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO 8 751 602.57

Valor da Unidade de Participação: € 12.9536