

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-04-30

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.						26 454
Ações						
EDP Renováveis	2 362	11.20	EUR	11.20		26 454
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					134 191	73 846 940
Títulos de Dívida Pública						
DBR 2.5% 01/2021	2 970 000	102.08%	EUR	102.08%	23 939	3 055 596
DBR 0.5% 08/27	1 300 000	109.06%	EUR	109.06%	4 617	1 422 423
DBR 1.25% 08/48	100 000	142.19%	EUR	142.19%	888	143 076
DBR 0.25% 02/2029	2 500 000	108.13%	EUR	108.13%	1 298	2 704 623
FRTR 4.25% 10/2023	2 150 000	117.07%	EUR	117.07%	47 185	2 564 083
FRTR 0.25% 11/26	1 440 000	103.83%	EUR	103.83%	1 554	1 496 634
FRTR 2% 05/48	850 000	137.44%	EUR	137.44%	15 885	1 184 151
SPGB 1.95% 07/2030	100 000	111.85%	EUR	111.85%	1 470	113 323
SPGB 3.45% 07/66	480 000	157.84%	EUR	157.84%	12 488	770 115
SPGB 0.45% 10/22	2 969 000	101.62%	EUR	101.62%	6 680	3 023 778
BTPS 4% 2/2037	300 000	124.40%	EUR	124.40%	2 967	376 155
BTPS 3.45% 03/48	400 000	117.63%	EUR	117.63%	2 288	472 820
CCTS Float 07/2023	1 300 000	98.44%	EUR	98.44%	1 453	1 281 212
IRISH 0% 10/22	400 000	101.10%	EUR	101.10%		404 400
						19 012 389
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
KFW 0% 04/2024	500 000	101.59%	EUR	101.59%		507 940
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	600 000	92.65%	EUR	92.65%	50	555 932
VW Float 07/21	200 000	98.36%	EUR	98.36%	16	196 740
SAPGR Float 03/21	300 000	99.63%	EUR	99.63%		298 890
VW Float 12/21	1 700 000	98.05%	EUR	98.05%	578	1 667 394
DB Float 12/2020	1 700 000	98.71%	EUR	98.71%	78	1 678 114
PBBGR Float 07/28/23	1 000 000	98.11%	EUR	98.11%	59	981 139
ACAFP Float 04/22	1 500 000	99.18%	EUR	99.18%	264	1 487 934
BNP Float 06/24	1 000 000	97.04%	EUR	97.04%	414	970 824
RENAUL Float 03/2022	400 000	96.26%	EUR	96.26%	93	385 137
GFCFP Float 06/22	500 000	98.69%	EUR	98.69%	14	493 444
RENAULT Float 11/24	400 000	87.57%	EUR	87.57%	171	350 443
ALDFP Float 11/20	200 000	99.52%	EUR	99.52%	5	199 049
BNP Float 05/23	300 000	97.77%	EUR	97.77%	117	293 418
SOCGEN FLT.062%01/21	500 000	99.73%	EUR	99.73%	27	498 677
ACAFP Float 01/2022	600 000	99.46%	EUR	99.46%	70	596 836
CAFP Float 09/2023	1 900 000	97.36%	EUR	97.36%	443	1 850 321
HSBC Float 09/22	350 000	98.82%	EUR	98.82%	113	345 986
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	95.80%	EUR	95.80%	419	958 389
HSBC Float 10/23	1 500 000	97.11%	EUR	97.11%	171	1 456 761
CCE FLOAT 11/21	800 000	99.30%	EUR	99.30%		794 424
RBS Float 09/21	1 200 000	99.10%	EUR	99.10%	620	1 189 796
RBS Float 03/21	500 000	99.44%	EUR	99.44%	146	497 341
IBESM Float 02/24	1 200 000	98.76%	EUR	98.76%	632	1 185 692
SANTAN Float 03/22	1 000 000	98.81%	EUR	98.81%	679	988 809
BBVASM Float 04/22	1 000 000	98.76%	EUR	98.76%	163	987 793

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
AMSSM Float 03/22	700 000	97.43%	EUR	97.43%	34	682 023
SANTAN Float 03/23	500 000	97.25%	EUR	97.25%	178	486 438
ISPIM Float 04/22	1 000 000	97.92%	EUR	97.92%	222	979 412
FCABNK Float 06/21	500 000	97.70%	EUR	97.70%		488 500
ISPIM Float 02/2021	500 000	99.30%	EUR	99.30%	590	497 075
GS Float 07/2021	200 000	99.70%	EUR	99.70%	19	199 427
MS Float 01/22	300 000	99.02%	EUR	99.02%	18	297 063
WFC Float 01/22	1 400 000	98.61%	EUR	98.61%	10	1 380 508
BAC Float 02/22	600 000	99.31%	EUR	99.31%	560	596 432
BAC Float 05/23	150 000	98.52%	EUR	98.52%	140	147 922
GM Float 05/21	800 000	94.74%	EUR	94.74%	506	758 407
BATSLN Float 08/21	500 000	99.23%	EUR	99.23%	91	496 241
F Float 12/22	300 000	83.76%	EUR	83.76%		251 289
C Float 03/23	1 150 000	97.98%	EUR	97.98%	133	1 126 903
GM Float 03/22	300 000	90.74%	EUR	90.74%	53	272 273
BAC FLOAT 04/24	800 000	97.43%	EUR	97.43%	48	779 488
T Float 09/23	1 500 000	98.20%	EUR	98.20%	1 005	1 474 035
FIS Float 05/2021	500 000	99.10%	EUR	99.10%		495 495
GS Float 04/2023	500 000	97.08%	EUR	97.08%	43	485 453
SCANIA Float 03/21	200 000	99.38%	EUR	99.38%	6	198 772
DAIGR Float 05/22	500 000	97.60%	EUR	97.60%		487 975
MYL Float 05/20	200 000	99.92%	EUR	99.92%	34	199 870
BAYNGR Float 06/22	1 500 000	98.34%	EUR	98.34%	266	1 475 306
INTNED Float 09/23	600 000	97.69%	EUR	97.69%	309	586 455
INTNED Float 11/21	200 000	99.35%	EUR	99.35%	2	198 700
ABNANV Flt. 12/21	200 000	99.24%	EUR	99.24%		198 478
INTNED Float 04/22	200 000	98.95%	EUR	98.95%	10	197 918
ANNGR Float 12/2022	1 600 000	97.65%	EUR	97.65%	99	1 562 515
NYKRE Float 06/22	700 000	97.71%	EUR	97.71%	169	684 153
JYBC Float 06/20	400 000	99.95%	EUR	99.95%		399 784
NYKRE Flt. 01/24	300 000	100.48%	EUR	100.48%	37	301 465
SPOLNO Float 09/21	200 000	98.93%	EUR	98.93%	29	197 885
DNBNO Flt. 07/22	600 000	99.36%	EUR	99.36%	39	596 211
CBSBKF Float 03/21	400 000	99.53%	EUR	99.53%	18	398 146
KBCBB Float 11/22	1 400 000	97.50%	EUR	97.50%	365	1 365 421
ABIBB Float 04/24	1 200 000	96.64%	EUR	96.64%	43	1 159 759
DLTAS 2008-1 A	420 086	98.50%	EUR	98.50%	12	413 797
DHR Float 06/22	950 000	98.02%	EUR	98.02%		931 171
DE FLOAT 10/22	2 100 000	97.87%	EUR	97.87%		2 055 186
SUMIBK Float 06/22	1 500 000	97.30%	EUR	97.30%		1 459 500
CBAAU Float 03/2023	700 000	97.88%	EUR	97.88%	32	685 206
BMO Float 03/22	200 000	98.81%	EUR	98.81%	3	197 613
GS Float 07/2022	600 000	98.57%	EUR	98.57%	56	591 470
GS Float 29/05/2020	200 000	99.97%	EUR	99.97%	97	200 035
GE FLOAT 5/21	1 700 000	98.70%	EUR	98.70%		1 677 900
ISPIM Float 06/20	1 200 000	99.98%	EUR	99.98%	860	1 200 656
						52 425 014
Ações						
BMW	551	54.05	EUR	54.05		29 782
DEUTSCHE BANK	4 068	6.78	EUR	6.78		27 573
SIEMENS	758	84.68	EUR	84.68		64 187

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ALLIANZ	177	168.88	EUR	168.88		29 892
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 554	9.15	EUR	9.15		14 213
BASF	665	46.69	EUR	46.69		31 046
BAYER AG	952	60.14	EUR	60.14		57 253
ADIDAS- SALOMON AG	112	209.20	EUR	209.20		23 430
SAP SE	682	108.94	EUR	108.94		74 297
DEUTSCHE TELEKOM	3 509	13.33	EUR	13.33		46 757
DAIMLER CHRYSLER	1 116	31.54	EUR	31.54		35 193
INFINEON TECHNOLOGIE	1 009	16.95	EUR	16.95		17 103
DEUTSCHE POST	1 498	27.15	EUR	27.15		40 671
FRESENIUS SE&CO KGAA	401	39.63	EUR	39.63		15 892
WIRECARD AG	88	90.40	EUR	90.40		7 955
SIEMENS HEALTHIN	455	40.20	EUR	40.20		18 291
DANONE	650	63.26	EUR	63.26		41 119
AXA-UAP	686	16.20	EUR	16.20		11 110
PERNOD RICARD	219	139.10	EUR	139.10		30 463
TOTAL SA	1 850	32.85	EUR	32.85		60 773
L OREAL	222	265.30	EUR	265.30		58 897
Kering	60	460.20	EUR	460.20		27 612
PEUGEOT CITROEN	1 373	13.08	EUR	13.08		17 952
BNP	1 376	28.68	EUR	28.68		39 457
AIR LIQUIDE	331	116.10	EUR	116.10		38 429
SCHNEIDER	214	83.46	EUR	83.46		17 860
L.V.M.H.	241	352.45	EUR	352.45		84 940
MICHELIN	126	89.10	EUR	89.10		11 227
SAINT-GOBAIN	623	24.21	EUR	24.21		15 083
BOUYGUES	418	28.11	EUR	28.11		11 750
EssilorLuxottica	208	112.65	EUR	112.65		23 431
GLE ENTREP. VINCI	446	74.70	EUR	74.70		33 316
DASSAULT SYSTEMES	93	133.55	EUR	133.55		12 420
SANOFI SYNHLABO	696	89.19	EUR	89.19		62 076
AIRBUS SE	533	57.88	EUR	57.88		30 850
CREDIT AGRICOLE SA	2 950	7.28	EUR	7.28		21 482
ILIAD SA	149	136.00	EUR	136.00		20 264
SAFRAN SA	129	84.22	EUR	84.22		10 864
HERMES INTERNACIONAL	22	667.80	EUR	667.80		14 692
TELEPERFORMANCE	57	204.50	EUR	204.50		11 657
RECKITT BENCKISER	219	66.30	GBP	76.38		16 726
ANGLO AMERICAN PLC	604	14.15	GBP	16.30		9 847
OCADO GROUP PLC	1 469	16.05	GBP	18.48		27 152
AMADEUS HOLDING SA	311	43.92	EUR	43.92		13 659
TELEFONICA	2 903	4.18	EUR	4.18		12 135
BCO SANTANDER C.HISP	18 827	2.04	EUR	2.04		38 360
IBERDROLA	3 324	9.14	EUR	9.14		30 381
REPSOL	1 184	8.31	EUR	8.31		9 844
FERROVIAL	458	22.80	EUR	22.80		10 442
INDITEX	1 222	23.25	EUR	23.25		28 412
TELECOM ITALIA	34 178	0.36	EUR	0.36		12 359
UNICREDITO ITALIANO	3 857	7.03	EUR	7.03		27 111
ENI SPA	983	8.71	EUR	8.71		8 566
ENEL	4 661	6.24	EUR	6.24		29 066

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ESSITY AKTIEBO-B	619	317.50	SEK	29.68		18 374
ASML NA	348	270.65	EUR	270.65		94 186
AKZO NOBEL NV NLG20	298	69.20	EUR	69.20		20 622
DSM NV	203	111.75	EUR	111.75		22 685
FIAT CHRYSLER AUTOM	1 223	8.02	EUR	8.02		9 804
UNILEVER NV	1 783	45.58	EUR	45.58		81 269
NOKIA A	2 836	3.32	EUR	3.32		9 427
SAMPO OYJ-A SHS	1 270	30.24	EUR	30.24		38 405
Neste Oyj	325	32.33	EUR	32.33		10 507
KBC BANKVERZEKERING	757	49.28	EUR	49.28		37 305
ERST BK DER OEST.SPA	1 380	19.83	EUR	19.83		27 359
CRH ORD	593	27.55	EUR	27.55		16 337
						1 901 598
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					1 470	3 321 287
Obrigações diversas						
F Float 12/21	1 000 000	90.41%	EUR	90.41%		904 110
F Float 05/21	250 000	93.09%	EUR	93.09%	9	232 722
UBS Float 09/22	1 500 000	98.32%	EUR	98.32%	511	1 475 266
TACHEM Float 11/22	700 000	99.23%	EUR	99.23%	950	695 532
						3 307 630
Ações						
ZURICH ALLIED AG	47	307.30	CHF	290.59		13 658
						77 194 682
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						11 788 398
CXG IMOBILIARIO	710 909	4.02	EUR	4.02		2 858 636
CAIXA PRIVATE EQUITY	40 509	5.63	EUR	5.63		228 179
CXG INFRAESTRUTURAS	79 838	7.81	EUR	7.81		623 846
Fundimo	1 034 798	7.81	EUR	7.81		8 077 737
OIC DOMICILIADOS NUM ESTADO-MEMBRO DA EU						13 909 775
ALLIANZ EUOLD EQY G	789	2 542.89	EUR	2 542.89		2 006 340
SCHRODER ISF EURO EQ	83 132	38.99	EUR	38.99		3 241 242
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	1 799.03	EUR	1 799.03		1 881 785
AMUNDI CASH INST SRI	3	217 838.40	EUR	217 838.40		653 515
EAST-US CB-CE HG	76 489	11.41	EUR	11.41		872 587
PGIS-CR BD-IN€HA	81 624	10.73	EUR	10.73		875 826
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	33 565	35.17	EUR	35.17		1 180 481
AB SCV I-EUZ EQ I	133 139	24.02	EUR	24.02		3 197 999
OIC DOMICI. EM ESTADOS NÃO MEMBROS DA EU						2 157
TISHMAN ESOF	91 579	0.02	EUR	0.02		2 157
						25 700 330
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

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
LIQUIDEZ						
À VISTA						7 013 154
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			859
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			67
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			6 512 004
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			265 557
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			972
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			83
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			53
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			863
DO SANTANDER US 0.0000%			USD			232 698
						7 013 154
						7 013 154
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
VALORES ACTIVOS						258 119
VALORES PASSIVOS						-176 825
						81 295
						117 263 461
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
VGM0 EUR EUX 06/20	25	2 877.00	EUR	2 877.00		719 250
ESM0 S&P500 06/20	10	2 887.50	USD	2 640.85		1 320 423
						2 039 673
						2 039 673
						2 039 673
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO						
					8 878 998.52	
Valor da Unidade de Participação:	€ 13.2068					