

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2021-06-30

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.						34 820
Ações						
EDP Renováveis	1 782	19.54	EUR	19.54		34 820
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					80 273	61 895 006
Títulos de Dívida Pública						
DBR 1.5% 02/2023	54 000	103.56%	EUR	103.56%	302	56 225
DBR 1.25% 08/48	547 000	126.16%	EUR	126.16%	5 995	696 106
DBR 0% 08/2050	315 000	91.92%	EUR	91.92%		289 548
BKO 0% 09/2022	709 000	100.82%	EUR	100.82%		714 814
FRTR 4.25% 10/2023	289 000	111.44%	EUR	111.44%	8 379	330 441
FRTR 3% 04/2022	1 633 000	102.98%	EUR	102.98%	8 993	1 690 574
FRTR 0.25% 11/26	4 354 000	103.45%	EUR	103.45%	6 800	4 511 143
SPGB 1.95% 07/2030	275 000	114.75%	EUR	114.75%	4 936	320 485
SPGB 3.45% 07/66	439 000	154.18%	EUR	154.18%	13 942	690 810
SPGB 0.45% 10/22	1 647 000	101.36%	EUR	101.36%	4 934	1 674 317
BTPS 4% 2/2037	269 000	138.06%	EUR	138.06%	4 459	375 835
BTPS 2% 12/2025	1 881 000	108.75%	EUR	108.75%	3 084	2 048 728
BTPS 3.45% 03/48	1 018 000	136.21%	EUR	136.21%	11 643	1 398 210
RAGB 0% 07/2023	1 084 000	101.25%	EUR	101.25%		1 097 583
IRISH 0% 10/22	337 000	100.78%	EUR	100.78%		339 618
CCTS Float 07/2023	1 300 000	101.06%	EUR	101.06%	1 043	1 314 810
EU 0% 07/2026	200 000	101.95%	EUR	101.95%		203 900
						17 753 147
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
KFW 0% 04/2024	422 000	101.53%	EUR	101.53%		428 452
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	600 000	100.56%	EUR	100.56%		603 372
VW Float 07/21	200 000	100.00%	EUR	100.00%		200 008
VW Float 12/21	1 700 000	100.22%	EUR	100.22%	167	1 703 890
PBBGR Float 07/28/23	1 000 000	100.97%	EUR	100.97%	644	1 010 364
DB Float 05/2022	2 400 000	100.41%	EUR	100.41%	777	2 410 569
ACAFP Float 04/22	1 500 000	100.58%	EUR	100.58%	786	1 509 501
SOCGEN Float 05/24	1 600 000	101.39%	EUR	101.39%	431	1 622 623
BNP Float 06/24	1 000 000	101.39%	EUR	101.39%	139	1 014 019
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.28%	EUR	100.28%	24	401 132
GFCFP Float 06/22	500 000	100.29%	EUR	100.29%		501 455
RENAULT Float 11/24	400 000	100.29%	EUR	100.29%	23	401 191
BNP Float 05/23	300 000	100.86%	EUR	100.86%	24	302 607
CAFP Float 09/2023	1 900 000	100.59%	EUR	100.59%	94	1 911 323
CCE FLOAT 11/21	800 000	100.11%	EUR	100.11%		800 896
IBESM Float 02/24	1 200 000	100.83%	EUR	100.83%	164	1 210 136
SANTAN Float 03/22	1 000 000	100.66%	EUR	100.66%	133	1 006 723
AMSSM Float 03/22	700 000	100.01%	EUR	100.01%		700 063
SANTAN Float 03/23	500 000	100.92%	EUR	100.92%	9	504 629
ISPIM Float 04/22	1 000 000	100.62%	EUR	100.62%	837	1 007 077
BACRED Float 05/22	1 000 000	100.46%	EUR	100.46%	307	1 004 887
GS Float 09/23	800 000	100.26%	EUR	100.26%	5	802 109
F Float 12/22	300 000	99.26%	EUR	99.26%		297 792

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2021-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
C Float 03/23	1 650 000	100.63%	EUR	100.63%		1 660 346
GM Float 03/22	300 000	100.14%	EUR	100.14%	0	300 408
T Float 09/23	1 500 000	101.21%	EUR	101.21%	345	1 518 435
GS Float 04/2023	500 000	100.18%	EUR	100.18%	13	500 928
DAIGR Float 05/22	500 000	100.27%	EUR	100.27%		501 365
BAYNGR Float 06/22	1 500 000	100.29%	EUR	100.29%	2	1 504 412
INTNED Float 09/23	600 000	101.55%	EUR	101.55%	51	609 363
ANNGR Float 12/2022	1 600 000	100.41%	EUR	100.41%		1 606 560
NYKRE Float 06/22	700 000	100.36%	EUR	100.36%	15	702 507
NYKRE Flt. 01/24	300 000	100.53%	EUR	100.53%		301 586
SPOLNO Float 09/21	200 000	100.09%	EUR	100.09%		200 188
SBBBSS Float 2/2023	1 300 000	100.14%	EUR	100.14%	243	1 302 050
KBCBB Float 11/22	1 600 000	100.63%	EUR	100.63%	8	1 610 120
DLTAS 2008-1 A	267 717	99.86%	EUR	99.86%	0	267 342
DHR Float 06/22	950 000	100.26%	EUR	100.26%		952 480
DE FLOAT 10/22	2 100 000	100.46%	EUR	100.46%		2 109 660
SUMIBK Float 06/22	1 500 000	100.40%	EUR	100.40%		1 506 060
MUFG Float 05/2023	1 400 000	100.62%	EUR	100.62%	17	1 408 725
GS Float 07/2022	600 000	100.78%	EUR	100.78%	507	605 175
						40 094 074
Ações						
BMW	747	89.31	EUR	89.31		66 715
DEUTSCHE BANK	5 199	10.99	EUR	10.99		57 116
SIEMENS	1 037	133.62	EUR	133.62		138 564
ALLIANZ	225	210.30	EUR	210.30		47 318
BASF	910	66.44	EUR	66.44		60 460
BAYER AG	1 888	51.21	EUR	51.21		96 684
RWE-RHEINISCH WEST..	438	30.56	EUR	30.56		13 385
ADIDAS- SALOMON AG	153	313.90	EUR	313.90		48 027
SAP SE	663	118.84	EUR	118.84		78 791
DEUTSCHE TELEKOM	4 801	17.81	EUR	17.81		85 515
DAIMLER CHRYSLER	528	75.30	EUR	75.30		39 758
INFINEON TECHNOLOGIE	401	33.82	EUR	33.82		13 562
DEUTSCHE POST	2 050	57.36	EUR	57.36		117 588
VOLKSWAGEN AG-PREF.	162	211.20	EUR	211.20		34 214
FRESENIUS SE&CO KGAA	753	44.00	EUR	44.00		33 128
SIEMENS HEALTHIN	727	51.68	EUR	51.68		37 571
Siemens Energy AG	519	25.42	EUR	25.42		13 193
DANONE	767	59.37	EUR	59.37		45 537
AXA-UAP	939	21.39	EUR	21.39		20 081
PERNOD RICARD	355	187.20	EUR	187.20		66 456
TotalEnergies SE	2 230	38.16	EUR	38.16		85 086
L OREAL	355	375.80	EUR	375.80		133 409
Kering	82	737.00	EUR	737.00		60 434
BNP	1 766	52.87	EUR	52.87		93 368
AIR LIQUIDE	453	147.66	EUR	147.66		66 890
SCHNEIDER	293	132.68	EUR	132.68		38 875
L.V.M.H.	317	661.30	EUR	661.30		209 632
MICHELIN	173	134.50	EUR	134.50		23 269
SAINT-GOBAIN	853	55.54	EUR	55.54		47 376
BOUYGUES	572	31.19	EUR	31.19		17 841

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2021-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
EssilorLuxottica	285	155.64	EUR	155.64		44 357
GLE ENTREP. VINCI	610	89.99	EUR	89.99		54 894
ST MICROELECTRON	1 558	30.61	EUR	30.61		47 683
DASSAULT SYSTEMES	208	204.50	EUR	204.50		42 536
SANOFI SYNHLABO	1 061	88.36	EUR	88.36		93 750
AIRBUS SE	729	108.44	EUR	108.44		79 053
CREDIT AGRICOLE SA	3 749	11.81	EUR	11.81		44 291
ILIAD SA	204	123.40	EUR	123.40		25 174
SAFRAN SA	177	116.92	EUR	116.92		20 695
HERMES INTERNACIONAL	30	1 228.50	EUR	1 228.50		36 855
TELEPERFORMANCE	78	342.30	EUR	342.30		26 699
TELEFONICA	3 973	3.94	EUR	3.94		15 658
BCO SANTANDER C.HISP	24 722	3.22	EUR	3.22		79 592
IBERDROLA	5 991	10.28	EUR	10.28		61 587
FERROVIAL	627	24.75	EUR	24.75		15 518
INDITEX	1 672	29.71	EUR	29.71		49 675
TELECOM ITALIA	46 811	0.42	EUR	0.42		19 609
UNICREDITO ITALIANO	4 902	9.95	EUR	9.95		48 775
ENI SPA	1 345	10.27	EUR	10.27		13 813
ENEL	8 341	7.83	EUR	7.83		65 327
ESSITY AKTIEBO-B	847	283.80	SEK	27.97		23 692
ASML NA	514	579.40	EUR	579.40		297 812
AKZO NOBEL NV NLG20	408	104.20	EUR	104.20		42 514
DSM NV	278	157.40	EUR	157.40		43 757
STELLANTIS NV	4 487	16.55	EUR	16.55		74 278
Prosus NV	592	82.47	EUR	82.47		48 822
Adyen NV	10	2 060.50	EUR	2 060.50		20 605
SAMPO OYJ-A SHS	1 645	38.76	EUR	38.76		63 760
Neste Oyj	358	51.64	EUR	51.64		18 487
KBC BANKVERZEKERING	970	64.30	EUR	64.30		62 371
ANHEUSER-BUSCH INB	966	60.81	EUR	60.81		58 742
ERST BK DER OEST.SPA	1 766	30.94	EUR	30.94		54 640
CRH ORD	811	42.50	EUR	42.50		34 468
						3 619 332
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					3 651	18 898 489
Títulos de Dívida Pública						
KOREA 0% 09/2025	200 000	100.53%	EUR	100.53%		201 056
Obrigações diversas						
HSBC Float 09/22	100 000	100.14%	EUR	100.14%	1	100 138
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	101.30%	EUR	101.30%	66	1 013 026
HSBC Float 10/23	1 500 000	100.40%	EUR	100.40%		1 505 940
RBS Float 09/21	1 200 000	100.19%	EUR	100.19%	36	1 202 316
BACR Float 05/2026	1 600 000	101.85%	EUR	101.85%	1 038	1 630 606
BBVASM Float 04/22	1 000 000	100.40%	EUR	100.40%	122	1 004 162
WFC Float 01/22	1 400 000	100.26%	EUR	100.26%		1 403 654
BAC Float 05/23	150 000	100.50%	EUR	100.50%	59	150 805
MS Float 11/22	1 200 000	100.21%	EUR	100.21%	291	1 202 859
BATSLN Float 08/21	500 000	100.03%	EUR	100.03%		500 170
F Float 12/21	1 000 000	99.84%	EUR	99.84%		998 360
F Float 12/24	550 000	97.10%	EUR	97.10%	72	534 100
BAC FLOAT 04/24	1 400 000	100.62%	EUR	100.62%	413	1 409 051

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2021-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
UBS Float 09/22	1 500 000	100.12%	EUR	100.12%	65	1 501 805
CS Float 01/2026	500 000	100.57%	EUR	100.57%	488	503 328
ABIBB Float 04/24	1 600 000	100.48%	EUR	100.48%		1 607 696
TACHEM Float 11/22	1 600 000	101.22%	EUR	101.22%	999	1 620 519
CBAAU Float 03/2023	700 000	100.80%	EUR	100.80%		705 621
						18 594 156
Ações						
RECKITT BENCKISER	369	63.97	GBP	74.53		27 502
ANGLO AMERICAN PLC	826	28.73	GBP	33.47		27 644
OCADO GROUP PLC	1 134	20.03	GBP	23.34		26 464
ZURICH ALLIED AG	64	371.20	CHF	338.55		21 667
						103 276
						80 828 315
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						12 291 959
CXG IMOBILIARIO	710 909	4.11	EUR	4.11		2 922 689
CAIXA PRIVATE EQUITY	40 509	6.06	EUR	6.06		245 557
CAIXA INFRAESTRUTURA	82 413	7.50	EUR	7.50		618 337
Fundímo	1 074 997	7.91	EUR	7.91		8 505 376
OIC DOMICILIADOS NUM ESTADO-MEMBRO DA EU						16 793 512
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 366	2 648.84	EUR	2 648.84		3 618 207
MORGAN-US AD-Z\$	1	203.51	USD	171.75		172
GROUPAMA MONE-IC	16	212 836.30	EUR	212 836.30		3 362 814
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	45 156	40.05	EUR	40.05		1 808 507
AB SCV I-EUZ EQ I	92 080	33.50	EUR	33.50		3 084 674
SCHRO-EU EQ-IZE	58 004	54.22	EUR	54.22		3 145 120
ISHARES EUR CORP.BON	12 658	140.15	EUR	140.15		1 774 019
OIC DOMICI. EM ESTADOS NÃO MEMBROS DA EU						613 374
TISHMAN ESOF	91 579	0.01	EUR	0.01		1 143
TROWE ROWE PRICE I	1	28.65	USD	24.18		24
ISHARES MSCI EMER.MK	13 170	55.08	USD	46.48		612 207
						29 698 845
OUTROS ACTIVOS						
Imóveis						
REPUBLICA 35- R/C	8	625 075.00	EUR	625 075.00		5 000 600
LIQUIDEZ						
À VISTA						2 994 478
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			1 313
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			25
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			1 961 414
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			394 114
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			2 538
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			49
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			920
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			10 645
DO SANTANDER US 0.0000%			USD			623 460
						2 994 478

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2021-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
						2 994 478
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
VALORES ACTIVOS						90 081
VALORES PASSIVOS						-363 064
						-272 983
						118 249 255
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
VGU1 EUR EUX 09/21	15	4 052.00	EUR	4 052.00		607 800
ESU1 S&P500 09/21	4	4 284.75	USD	3 616.13		723 226
						1 331 026
						1 331 026
						1 331 026
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO						
					8 475 787.00	
Valor da Unidade de Participação: € 13.9514						