

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-07-31

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.						32 785
Ações						
EDP Renováveis	2 362	13.88	EUR	13.88		32 785
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					112 883	75 626 561
Títulos de Dívida Pública						
DBR 2.5% 01/2021	1 000 000	101.38%	EUR	101.38%	14 344	1 028 104
DBR 1.5% 02/2023	2 912 000	105.80%	EUR	105.80%	20 050	3 100 946
FRTR 4.25% 10/2023	300 000	115.96%	EUR	115.96%	9 789	357 663
FRTR 3% 04/2022	1 700 000	106.32%	EUR	106.32%	13 693	1 821 082
FRTR 0.25% 11/26	4 440 000	104.70%	EUR	104.70%	7 582	4 656 084
SPGB 3.45% 07/66	480 000	171.36%	EUR	171.36%	91	822 638
SPGB 0.45% 10/22	1 800 000	101.90%	EUR	101.90%	6 086	1 840 250
BTPS 4% 2/2037	300 000	135.43%	EUR	135.43%	6 000	412 278
BTPS 3.45% 03/48	1 136 000	132.58%	EUR	132.58%	16 295	1 522 381
CCTS Float 07/2023	1 300 000	100.47%	EUR	100.47%	226	1 306 284
RAGB 0.75% 10/26	600 000	108.04%	EUR	108.04%	3 516	651 756
RAGB 0% 07/2023	2 000 000	101.80%	EUR	101.80%		2 036 040
IRISH 0% 10/22	400 000	101.32%	EUR	101.32%		405 272
						19 960 778
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
KFW 0% 04/2024	500 000	102.13%	EUR	102.13%		510 640
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	600 000	96.91%	EUR	96.91%	16	581 464
VW Float 07/21	200 000	99.62%	EUR	99.62%	3	199 239
SAPGR Float 03/21	300 000	99.96%	EUR	99.96%		299 886
VW Float 12/21	1 700 000	99.72%	EUR	99.72%	887	1 696 042
DB Float 12/2020	1 700 000	99.93%	EUR	99.93%	377	1 699 255
PBBGR Float 07/28/23	1 000 000	99.75%	EUR	99.75%	50	997 510
ACAFP Float 04/22	1 500 000	100.67%	EUR	100.67%	176	1 510 256
BNP Float 06/24	1 000 000	99.90%	EUR	99.90%	597	999 617
RENAUL Float 03/2022	400 000	98.22%	EUR	98.22%	163	393 027
GFCFP Float 06/22	500 000	99.35%	EUR	99.35%		496 755
RENAULT Float 11/24	400 000	93.32%	EUR	93.32%	306	373 590
ALDFP Float 11/20	200 000	99.82%	EUR	99.82%	57	199 699
BNP Float 05/23	300 000	99.93%	EUR	99.93%	201	299 979
SOCGEN FLT 14/01/21	500 000	100.16%	EUR	100.16%		500 775
ACAFP Float 01/2022	600 000	100.49%	EUR	100.49%	27	602 967
CAFP Float 09/2023	1 900 000	99.70%	EUR	99.70%	755	1 894 960
HSBC Float 09/22	350 000	100.14%	EUR	100.14%	101	350 588
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	99.53%	EUR	99.53%	434	995 744
HSBC Float 10/23	1 500 000	99.10%	EUR	99.10%	77	1 486 577
CCE FLOAT 11/21	800 000	99.95%	EUR	99.95%		799 600
RBS Float 09/21	1 200 000	100.61%	EUR	100.61%	548	1 207 820
RBS Float 03/21	500 000	100.19%	EUR	100.19%	263	501 213
IBESM Float 02/24	1 200 000	99.17%	EUR	99.17%	959	1 191 047
SANTAN Float 03/22	1 000 000	100.20%	EUR	100.20%	701	1 002 711
BBVASM Float 04/22	1 000 000	100.15%	EUR	100.15%	86	1 001 566
AMSSM Float 03/22	700 000	98.05%	EUR	98.05%	67	686 389

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
 Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2020-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
SANTAN Float 03/23	500 000	99.75%	EUR	99.75%	160	498 900
ISPIM Float 04/22	1 000 000	99.95%	EUR	99.95%	167	999 627
FCABNK Float 06/21	500 000	98.83%	EUR	98.83%		494 130
ISPIM Float 02/2021	500 000	99.88%	EUR	99.88%	723	500 118
GS Float 07/2021	200 000	100.72%	EUR	100.72%	15	201 457
MS Float 01/22	300 000	100.14%	EUR	100.14%	10	300 442
WFC Float 01/22	1 400 000	100.16%	EUR	100.16%	2	1 402 186
BAC Float 02/22	600 000	100.22%	EUR	100.22%	721	602 035
BAC Float 05/23	150 000	100.31%	EUR	100.31%	192	150 651
MS Float 11/22	1 200 000	100.15%	EUR	100.15%	1 208	1 202 984
GM Float 05/21	800 000	98.91%	EUR	98.91%	769	792 046
BATSLN Float 08/21	500 000	99.71%	EUR	99.71%	248	498 773
F Float 12/22	300 000	92.65%	EUR	92.65%	31	277 978
C Float 03/23	1 150 000	99.84%	EUR	99.84%	142	1 148 302
GM Float 03/22	300 000	96.80%	EUR	96.80%	46	290 440
BAC FLOAT 04/24	800 000	99.94%	EUR	99.94%	27	799 547
T Float 09/23	1 500 000	99.73%	EUR	99.73%	1 257	1 497 192
FIS Float 05/2021	500 000	99.72%	EUR	99.72%	141	498 746
GS Float 04/2023	500 000	99.29%	EUR	99.29%	16	496 481
SCANIA Float 03/21	200 000	99.73%	EUR	99.73%	24	199 486
DAIGR Float 05/22	500 000	99.54%	EUR	99.54%	48	497 728
BAYNGR Float 06/22	1 500 000	99.74%	EUR	99.74%	228	1 496 253
INTNED Float 09/23	600 000	100.36%	EUR	100.36%	307	602 461
INTNED Float 11/21	200 000	100.42%	EUR	100.42%	52	200 900
ABNANV Flt. 12/21	200 000	100.42%	EUR	100.42%	25	200 873
INTNED Float 04/22	200 000	100.40%	EUR	100.40%		200 792
ANNGR Float 12/2022	1 600 000	99.40%	EUR	99.40%	108	1 590 444
NYKRE Float 06/22	700 000	99.67%	EUR	99.67%	307	698 025
NYKRE Flt. 01/24	300 000	100.50%	EUR	100.50%	22	301 515
SPOLNO Float 09/21	200 000	100.26%	EUR	100.26%	22	200 548
DNBNO Flt. 07/22	600 000	100.99%	EUR	100.99%	25	605 953
CBSBKF Float 03/21	400 000	99.93%	EUR	99.93%	89	399 821
KBCBB Float 11/22	1 600 000	99.95%	EUR	99.95%	810	1 600 058
ABIBB Float 04/24	1 600 000	98.83%	EUR	98.83%		1 581 280
DLTAS 2008-1 A	387 474	99.64%	EUR	99.64%	5	386 085
DHR Float 06/22	950 000	99.54%	EUR	99.54%		945 668
DE FLOAT 10/22	2 100 000	99.31%	EUR	99.31%		2 085 405
SUMIBK Float 06/22	1 500 000	99.86%	EUR	99.86%	180	1 498 080
CBAAU Float 03/2023	700 000	100.32%	EUR	100.32%	151	702 405
BMO Float 03/22	200 000	100.31%	EUR	100.31%	37	200 659
GS Float 07/2022	600 000	100.30%	EUR	100.30%	46	601 828
GE FLOAT 5/21	1 700 000	99.71%	EUR	99.71%		1 694 985
						53 111 561
Ações						
BMW	551	54.70	EUR	54.70		30 140
DEUTSCHE BANK	4 068	7.59	EUR	7.59		30 880
SIEMENS	758	108.32	EUR	108.32		82 107
ALLIANZ	177	176.22	EUR	176.22		31 191
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 554	9.94	EUR	9.94		15 441
BASF	665	46.81	EUR	46.81		31 129
BAYER AG	1 088	56.24	EUR	56.24		61 189

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ADIDAS- SALOMON AG	112	233.90	EUR	233.90		26 197
SAP SE	682	133.78	EUR	133.78		91 238
DEUTSCHE TELEKOM	3 509	14.17	EUR	14.17		49 705
DAIMLER CHRYSLER	386	37.40	EUR	37.40		14 436
INFINEON TECHNOLOGIE	1 009	21.13	EUR	21.13		21 320
DEUTSCHE POST	1 498	34.26	EUR	34.26		51 321
FRESENIUS SE&CO KGAA	490	42.27	EUR	42.27		20 712
SIEMENS HEALTHIN	483	43.96	EUR	43.96		21 230
DANONE	650	56.54	EUR	56.54		36 751
AXA-UAP	686	16.86	EUR	16.86		11 569
PERNOD RICARD	219	146.00	EUR	146.00		31 974
TOTAL SE	1 850	31.30	EUR	31.30		57 905
L OREAL	222	283.00	EUR	283.00		62 826
Kering	60	481.75	EUR	481.75		28 905
PEUGEOT CITROEN	1 373	13.64	EUR	13.64		18 728
BNP	1 376	34.12	EUR	34.12		46 942
AIR LIQUIDE	331	139.60	EUR	139.60		46 208
SCHNEIDER	214	98.24	EUR	98.24		21 023
L.V.M.H.	232	366.75	EUR	366.75		85 086
MICHELIN	126	88.34	EUR	88.34		11 131
SAINT-GOBAIN	623	31.17	EUR	31.17		19 419
BOUYGUES	418	30.00	EUR	30.00		12 540
EssilorLuxottica	208	112.20	EUR	112.20		23 338
GLE ENTREP. VINCI	446	72.80	EUR	72.80		32 469
DASSAULT SYSTEMES	93	154.10	EUR	154.10		14 331
SANOFI SYNHLABO	712	88.55	EUR	88.55		63 048
AIRBUS SE	533	62.01	EUR	62.01		33 051
CREDIT AGRICOLE SA	2 950	8.13	EUR	8.13		23 972
ILIAD SA	149	166.40	EUR	166.40		24 794
SAFRAN SA	129	89.44	EUR	89.44		11 538
HERMES INTERNACIONAL	22	686.20	EUR	686.20		15 096
TELEPERFORMANCE	57	247.30	EUR	247.30		14 096
RECKITT BENCKISER	219	77.06	GBP	85.59		18 745
ANGLO AMERICAN PLC	604	18.70	GBP	20.77		12 547
OCADO GROUP PLC	829	20.53	GBP	22.80		18 904
AMADEUS HOLDING SA	311	42.36	EUR	42.36		13 174
TELEFONICA	2 903	3.55	EUR	3.55		10 300
BCO SANTANDER C.HISP	18 827	1.81	EUR	1.81		34 051
IBERDROLA	3 324	10.92	EUR	10.92		36 298
REPSOL	1 184	6.58	EUR	6.58		7 791
FERROVIAL	458	20.74	EUR	20.74		9 499
INDITEX	1 222	22.52	EUR	22.52		27 519
TELECOM ITALIA	34 178	0.34	EUR	0.34		11 648
UNICREDITO ITALIANO	3 857	7.72	EUR	7.72		29 780
ENI SPA	983	7.54	EUR	7.54		7 413
ENEL	4 661	7.73	EUR	7.73		36 025
ESSITY AKTIEBO-B	619	288.50	SEK	27.89		17 262
ASML NA	348	299.70	EUR	299.70		104 296
AKZO NOBEL NV NLG20	298	79.74	EUR	79.74		23 763
DSM NV	203	129.60	EUR	129.60		26 309
FIAT CHRYSLER AUTOM	1 001	8.62	EUR	8.62		8 629

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
UNILEVER NV	1 783	50.08	EUR	50.08		89 293
Prosus NV	382	82.10	EUR	82.10		31 362
NOKIA A	2 836	4.06	EUR	4.06		11 514
SAMPO OYJ-A SHS	1 270	30.67	EUR	30.67		38 951
Neste Oyj	325	38.88	EUR	38.88		12 636
KBC BANKVERZEKERING	757	48.32	EUR	48.32		36 578
ERST BK DER OEST.SPA	1 380	18.90	EUR	18.90		26 082
CRH ORD	593	30.76	EUR	30.76		18 241
						2 043 582
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					2 269	3 617 787
Obrigações diversas						
F Float 12/21	1 000 000	94.77%	EUR	94.77%	136	947 786
F Float 05/21	250 000	96.97%	EUR	96.97%	101	242 514
UBS Float 09/22	1 500 000	100.21%	EUR	100.21%	518	1 503 638
TACHEM Float 11/22	900 000	100.85%	EUR	100.85%	1 514	909 182
						3 603 120
Acções						
ZURICH ALLIED AG	47	336.20	CHF	312.06		14 667
						79 277 133
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						11 833 298
CXG IMOBILIARIO	710 909	4.02	EUR	4.02		2 855 864
CAIXA PRIVATE EQUITY	40 509	5.24	EUR	5.24		212 300
CXG INFRAESTRUTURAS	79 838	7.35	EUR	7.35		587 169
Fundimo	1 048 175	7.80	EUR	7.80		8 177 966
OIC DOMICILIADOS NUM ESTADO-MEMBRO DA EU						13 881 034
ALLIANZ EUOLD EQY G	489	2 876.80	EUR	2 876.80		1 406 755
SCHRODER ISF EURO EQ	77 523	42.24	EUR	42.24		3 274 858
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	2 036.80	EUR	2 036.80		2 130 493
AMUNDI CASH INST SRI	3	217 644.60	EUR	217 644.60		652 934
EAST-US CB-CE HG	76 489	12.14	EUR	12.14		928 729
PGIS-CR BD-IN€HA	81 624	11.44	EUR	11.44		933 779
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	33 565	37.14	EUR	37.14		1 246 604
AB SCV I-EUZ EQ I	126 749	26.09	EUR	26.09		3 306 881
OIC DOMICI. EM ESTADOS NÃO MEMBROS DA EU						2 157
TISHMAN ESOF	91 579	0.02	EUR	0.02		2 157
						25 716 489
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						7 322 559
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			1 075
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			67

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			6 623 992
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			345 675
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			1 508
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			86
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			54
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			3 966
DO SANTANDER US 0.0000%			USD			346 135
						7 322 559
						7 322 559
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
VALORES ACTIVOS						235 752
VALORES PASSIVOS						-173 506
						62 246
						119 652 426

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO

RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES

Em mercado regulamentado

Futuros

VGU0 EUR EUX 09/20	25	3 145.00	EUR	3 145.00		786 250
ESU0 S&P500 09/20	10	3 225.75	USD	2 729.06		1 364 530
						2 150 780
						2 150 780
						2 150 780

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

8 857 374.89

Valor da Unidade de Participação: € 13.5088