

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2019-08-31

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.						23 667
Acções						
EDP Renováveis	2 362	10.02	EUR	10.02		23 667
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					165 684	74 339 457
Títulos de Dívida Pública						
DBR 2.5% 01/2021	730 000	104.74%	EUR	104.74%	12 000	776 595
DBR 1.5% 02/2023	3 677 000	108.71%	EUR	108.71%	29 920	4 027 260
DBR 1.25% 08/48	200 000	143.50%	EUR	143.50%	116	287 118
FRTR 4.25% 10/2023	1 400 000	121.49%	EUR	121.49%	50 697	1 751 515
FRTR 3% 04/2022	777 000	110.35%	EUR	110.35%	8 216	865 659
FRTR 0.25% 11/26	940 000	106.23%	EUR	106.23%	1 803	1 000 355
FRTR 2% 05/48	100 000	144.49%	EUR	144.49%	541	145 032
SPGB 1.95% 07/2030	400 000	119.39%	EUR	119.39%	703	478 263
SPGB 3.45% 07/66	440 000	173.71%	EUR	173.71%	1 369	765 679
SPGB 0.45% 10/22	2 969 000	103.04%	EUR	103.04%	11 164	3 070 511
BTPS 4% 2/2037	1 750 000	136.18%	EUR	136.18%	5 897	2 389 064
BTPS 2% 12/2025	1 302 000	108.74%	EUR	108.74%	6 546	1 422 340
BOTS 0% 12/2019	1 008 000	99.83%	EUR	99.83%	2 667	1 009 001
T 2.515% 01/2020	290 000	97.79%	USD	97.79%	3 560	261 592
NETHER 0.75% 07/28	870 000	112.41%	EUR	112.41%	856	978 788
RAGB 0.75% 10/26	1 500 000	109.85%	EUR	109.85%	9 740	1 657 475
RAGB 0% 07/2023	535 000	103.10%	EUR	103.10%		551 596
IRISH 0% 10/22	400 000	102.08%	EUR	102.08%		408 308
CHILE 0.83% 07/2031	400 000	106.11%	EUR	106.11%	553	424 997
CCTS Float 11/19	800 000	100.23%	EUR	100.23%	2 347	804 171
CCTS Float 12/20	500 000	100.69%	EUR	100.69%	586	504 041
						23 579 361
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	400 000	101.47%	EUR	101.47%	24	405 886
KFW 0% 04/2024	500 000	103.13%	EUR	103.13%		515 650
						921 536
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	600 000	99.47%	EUR	99.47%	104	596 906
VW Float 07/21	200 000	100.01%	EUR	100.01%	29	200 051
SAPGR Float 03/21	300 000	100.36%	EUR	100.36%		301 065
VW Float 12/21	700 000	100.49%	EUR	100.49%	608	704 010
CMZB Flt .134% 12/20	300 000	100.40%	EUR	100.40%	95	301 280
SAPGR Float 12/2020	200 000	100.34%	EUR	100.34%		200 688
DB Float 12/2020	1 700 000	99.11%	EUR	99.11%	731	1 685 533
ACAFP Float 04/22	1 500 000	101.21%	EUR	101.21%	735	1 518 915
BNP Float 06/24	1 000 000	100.97%	EUR	100.97%	1 027	1 010 727
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.28%	EUR	100.28%	309	401 413
RENAULT Float 11/24	400 000	98.22%	EUR	98.22%	60	392 952
ALDFP Float 11/20	300 000	100.18%	EUR	100.18%	1	300 544
BNP Float 05/23	300 000	100.60%	EUR	100.60%	17	301 823
SOCGEN FLT.062%01/21	500 000	100.40%	EUR	100.40%	4	501 979
ACAFP Float 01/2022	600 000	100.78%	EUR	100.78%	143	604 841
HSBC Float 09/22	350 000	100.57%	EUR	100.57%	228	352 219

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2019-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
RBS Float 06/20	1 000 000	100.08%	EUR	100.08%	247	1 001 087
LLOYDS Float 06/2024	500 000	98.89%	EUR	98.89%	444	494 904
HSBC Float 10/23	1 500 000	99.79%	EUR	99.79%	355	1 497 235
CCE FLOAT 11/21	800 000	100.38%	EUR	100.38%		803 064
RBS Float 03/2020	200 000	100.08%	EUR	100.08%	40	200 198
IBESM Float 02/24	700 000	100.82%	EUR	100.82%	58	705 816
SANTAN Float 03/22	1 000 000	101.01%	EUR	101.01%	1 368	1 011 458
BBVASM Float 04/22	1 000 000	100.76%	EUR	100.76%	343	1 007 953
AMSSM Float 03/22	200 000	100.16%	EUR	100.16%	55	200 377
SCANIA Float 04/20	300 000	100.11%	EUR	100.11%	10	300 331
FCABNK Float 06/21	500 000	99.92%	EUR	99.92%	13	499 608
ISPIM Float 02/2021	500 000	100.57%	EUR	100.57%	28	502 883
GS Float 07/2021	700 000	101.40%	EUR	101.40%	411	710 211
MS Float 01/22	300 000	100.49%	EUR	100.49%	91	301 549
WFC Float 01/22	1 100 000	100.40%	EUR	100.40%	130	1 104 508
BAC Float 02/22	600 000	100.63%	EUR	100.63%	173	603 977
BAC Float 05/23	150 000	100.86%	EUR	100.86%	45	151 341
GM Float 05/21	800 000	100.37%	EUR	100.37%	125	803 045
BATSLN Float 08/21	500 000	99.99%	EUR	99.99%	21	499 976
C Float 03/23	500 000	100.25%	EUR	100.25%	164	501 434
GM Float 03/22	300 000	98.93%	EUR	98.93%	116	296 903
BAC FLOAT 04/24	400 000	100.60%	EUR	100.60%	138	402 554
T Float 09/23	1 000 000	101.37%	EUR	101.37%	1 305	1 015 045
NDASS Float 09/21	400 000	100.73%	EUR	100.73%	114	403 030
UBS Float 04/2021	500 000	100.56%	EUR	100.56%	69	502 864
SCANIA Float 03/21	200 000	99.97%	EUR	99.97%	56	200 004
DAIGR Float 05/22	100 000	99.80%	EUR	99.80%		99 804
MYL Float 05/20	200 000	99.93%	EUR	99.93%	4	199 872
ANNGR FLOAT 11/19	400 000	100.04%	EUR	100.04%		400 152
DAIGR Float 04/20	200 000	100.15%	EUR	100.15%	42	200 332
TOYOTA FLT 04/27	500 000	100.14%	EUR	100.14%		500 693
BAYNGR Float 06/22	1 500 000	100.10%	EUR	100.10%	578	1 502 018
INTNED Float 09/23	300 000	101.74%	EUR	101.74%	321	305 532
INTNED Float 11/21	200 000	100.60%	EUR	100.60%	0	201 202
ABNANV Flt. 12/21	200 000	100.61%	EUR	100.61%	40	201 260
ABNANV Flt.092%01/21	200 000	100.41%	EUR	100.41%	10	200 838
INTNED Float 04/22	200 000	100.61%	EUR	100.61%	14	201 230
NYKRE Float 06/22	700 000	99.72%	EUR	99.72%	438	698 457
JYBC Float 06/20	400 000	100.14%	EUR	100.14%	30	400 574
NYKRE Flt.184% 01/24	300 000	101.18%	EUR	101.18%	81	303 633
SPOLNO Float 09/21	200 000	99.89%	EUR	99.89%	64	199 838
DNBNO Flt. 07/22	600 000	101.38%	EUR	101.38%	239	608 525
CBSBKF Float 03/21	400 000	100.18%	EUR	100.18%	163	400 897
KBCBB Float 11/22	1 400 000	100.74%	EUR	100.74%	31	1 410 391
DLTAS 2008-1 A	506 814	100.06%	EUR	100.06%	20	507 139
DHR Float 06/22	950 000	99.91%	EUR	99.91%		949 174
DE Float 09/20	100 000	100.28%	EUR	100.28%		100 276
SUMIBK Float 06/22	1 000 000	100.33%	EUR	100.33%	290	1 003 570
NAB Float 04/2021	300 000	100.75%	EUR	100.75%	74	302 324
BMO Float 09/21	200 000	100.68%	EUR	100.68%	57	201 407
BMO Float 03/22	200 000	100.69%	EUR	100.69%	80	201 458

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2019-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BNFP Float 01/2020	700 000	100.04%	EUR	100.04%		700 245
CAFP Float 03/2020	800 000	100.10%	EUR	100.10%	304	801 096
CBAAUFloat 01/2020	700 000	100.16%	EUR	100.16%	24	701 116
UPS Float 07/2020	200 000	100.26%	EUR	100.26%	18	200 532
DE Float 04/20	300 000	100.17%	EUR	100.17%		300 501
JPM Float 01/2020	300 000	100.20%	EUR	100.20%	49	300 652
GS Float 07/2022	600 000	101.67%	EUR	101.67%	385	610 399
GS Float 29/05/2020	750 000	100.39%	EUR	100.39%	18	752 965
C Float 11/2019	700 000	100.09%	EUR	100.09%	59	700 696
SAPGR Float 04/2020	200 000	100.18%	EUR	100.18%		200 360
MMM Float 05/20	800 000	100.23%	EUR	100.23%		801 840
SKYLN Float 04/20	300 000	100.30%	EUR	100.30%	210	301 107
UCGIM Float 02/2020	750 000	100.33%	EUR	100.33%	161	752 644
DNBNO Float 01/2020	500 000	100.13%	EUR	100.13%		500 650
RABOBK Float 05/2020	300 000	100.28%	EUR	100.28%		300 852
FCE Float 09/17/19	250 000	100.03%	EUR	100.03%	349	250 419
ISPIM Float 06/20	1 300 000	100.50%	EUR	100.50%	2 009	1 308 548
GE Float 01/2020	1 300 000	99.79%	EUR	99.79%	15	1 297 337
GIS Float 01/2020	400 000	100.19%	EUR	100.19%	195	400 963
						47 579 816
Acções						
BMW	279	60.81	EUR	60.81		16 966
SIEMENS	661	90.95	EUR	90.95		60 118
ALLIANZ	225	200.50	EUR	200.50		45 113
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 554	8.46	EUR	8.46		13 139
BASF	423	60.18	EUR	60.18		25 456
BAYER AG	952	67.34	EUR	67.34		64 108
ADIDAS- SALOMON AG	149	269.70	EUR	269.70		40 185
SAP SE	682	108.60	EUR	108.60		74 065
DEUTSCHE TELEKOM	1 578	15.18	EUR	15.18		23 948
DAIMLER CHRYSLER	715	42.71	EUR	42.71		30 534
DEUTSCHE POST	900	29.90	EUR	29.90		26 910
PORSCHE AG-PFD	189	57.06	EUR	57.06		10 784
VOLKSWAGEN AG-PREF.	172	146.10	EUR	146.10		25 129
CONTINENTAL AG	82	109.76	EUR	109.76		9 000
FRESENIUS SE&CO KGAA	401	44.16	EUR	44.16		17 708
WIRECARD AG	213	145.10	EUR	145.10		30 906
COVESTRO AG	478	41.19	EUR	41.19		19 689
SIEMENS HEALTHIN	455	35.71	EUR	35.71		16 248
DANONE	650	81.46	EUR	81.46		52 949
AXA-UAP	642	20.87	EUR	20.87		13 399
PERNOD RICARD	219	173.70	EUR	173.70		38 040
TOTAL SA	1 240	45.39	EUR	45.39		56 284
L OREAL	222	248.60	EUR	248.60		55 189
Kering	60	440.40	EUR	440.40		26 424
BNP	339	41.04	EUR	41.04		13 911
AIR LIQUIDE	106	126.65	EUR	126.65		13 425
SCHNEIDER	490	76.16	EUR	76.16		37 318
L.V.M.H.	222	362.40	EUR	362.40		80 453
MICHELIN	126	95.60	EUR	95.60		12 046
SAINT-GOBAIN	505	32.82	EUR	32.82		16 574

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2019-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
THOMSON	113	105.15	EUR	105.15		11 882
RENAULT SA	178	52.16	EUR	52.16		9 284
EssilorLuxottica	208	134.25	EUR	134.25		27 924
ORANGE	3 174	13.80	EUR	13.80		43 801
GLE ENTREP. VINCI	523	99.50	EUR	99.50		52 039
SANOFI SYNHLABO	696	78.12	EUR	78.12		54 372
AIRBUS SE	450	125.34	EUR	125.34		56 403
CREDIT AGRICOLE SA	3 431	10.39	EUR	10.39		35 648
SAFRAN SA	292	132.15	EUR	132.15		38 588
HERMES INTERNACIONAL	22	621.00	EUR	621.00		13 662
3I GROUP	1 212	10.97	GBP	12.14		14 714
PRUDENTIAL CORP.	1 736	13.68	GBP	15.15		26 294
RECKITT BENCKISER	219	63.99	GBP	70.85		15 516
ANGLO AMERICAN PLC	763	17.74	GBP	19.64		14 988
OCADO GROUP PLC	1 469	12.96	GBP	14.34		21 071
INFORMA PLC	1 760	8.70	GBP	9.63		16 953
TELEFONICA	1 873	6.30	EUR	6.30		11 802
BCO SANTANDER C.HISP	20 515	3.44	EUR	3.44		70 572
IBERDROLA	3 324	9.35	EUR	9.35		31 086
REPSOL	1 704	13.22	EUR	13.22		22 527
BCO. BILBAO VISCAYA	5 432	4.31	EUR	4.31		23 406
INDITEX	915	28.12	EUR	28.12		25 730
Aena SME SA	83	164.00	EUR	164.00		13 612
MASMOVIL IBERCOM	930	18.62	EUR	18.62		17 317
MEDIOBANCA	2 981	9.01	EUR	9.01		26 859
TELECOM ITALIA	31 301	0.48	EUR	0.48		15 162
UNICREDITO ITALIANO	796	10.06	EUR	10.06		8 008
BANCA INTESA	5 500	1.99	EUR	1.99		10 963
ENEL	4 661	6.59	EUR	6.59		30 735
ATLANTIA SPA	516	22.17	EUR	22.17		11 440
EXOR NV	327	61.50	EUR	61.50		20 111
ESSITY AKTIEBO-B	619	306.10	SEK	28.33		17 539
ING GROEP NV	4 200	8.70	EUR	8.70		36 527
KONINKLIJKE KPN	5 362	2.88	EUR	2.88		15 443
ASML NA	423	202.25	EUR	202.25		85 552
AKZO NOBEL NV NLG20	379	81.47	EUR	81.47		30 877
DSM NV	340	113.10	EUR	113.10		38 454
FIAT CHRYSLER AUTOM	845	11.84	EUR	11.84		10 003
UNILEVER NV	1 783	56.44	EUR	56.44		100 633
NOKIA A	7 639	4.50	EUR	4.50		34 372
Neste Oyj	1 115	28.64	EUR	28.64		31 934
KONE OYJ-B	317	52.60	EUR	52.60		16 674
ERST BK DER OEST.SPA	1 186	29.27	EUR	29.27		34 714
BAWAG Group AG	857	34.52	EUR	34.52		29 584
CRH ORD	593	30.28	EUR	30.28		17 956
						2 258 743
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					1 492	4 521 079
Obrigações diversas						
F Float 12/21	1 000 000	98.84%	EUR	98.84%	125	988 565
UBS Float 09/22	1 500 000	100.71%	EUR	100.71%	1 150	1 511 860
AGM Float 11/20	100 000	100.07%	EUR	100.07%		100 068

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2019-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
SUMIBK Float 09/20	100 000	100.36%	EUR	100.36%	29	100 388
TACHEM Float 11/22	700 000	102.22%	EUR	102.22%	145	715 678
TACHEM Float 11/20	1 100 000	100.41%	EUR	100.41%	43	1 104 520
						4 521 079
						78 884 203
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						
						7 135 965
CXG IMOBILIARIO	710 909	3.99	EUR	3.99		2 834 039
CAIXA PRIVATE EQUITY	40 509	5.46	EUR	5.46		221 264
CXG INFRAESTRUTURAS	77 407	7.59	EUR	7.59		587 682
Fundimo	461 223	7.57	EUR	7.57		3 492 980
OIC DOMICILIADOS NUM ESTADO-MEMBRO DA EU						
						14 212 817
ALLIANZ EUOLD EQY G	181	2 576.17	EUR	2 576.17		466 287
JANUS HEND H. PAN AL	8 862	16.08	EUR	16.08		142 501
SCHRODER ISF EURO EQ	54 823	42.06	EUR	42.06		2 305 921
MERRILL LYNCH MARSH	2 380	138.58	EUR	138.58		329 820
JAN HND UK ABS RET	47 051	7.05	EUR	7.05		331 714
MERIAN GLOBAL INVEST	134 786	1.45	EUR	1.45		195 763
SCH EUROP ALPHA ABS	2 182	95.70	EUR	95.70		208 828
LYXOR EPSILON GLOB E	1 423	138.35	EUR	138.35		196 874
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	1 818.95	EUR	1 818.95		1 902 622
AMUNDI CASH INST SRI	9	218 410.70	EUR	218 410.70		1 965 696
JANUS HEND HORIZ EUR	163 499	14.23	EUR	14.23		2 326 591
LFIS-VIS PR-M€A	574	1 033.31	EUR	1 033.31		593 120
DNCA INVEST-MIURA-I	917	110.46	EUR	110.46		101 292
MLIS PSAM GL EV UC A	1 951	135.33	EUR	135.33		264 014
AM-EURL EQ-I2EC	249 952	9.25	EUR	9.25		2 312 056
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	15 052	37.85	EUR	37.85		569 718
OIC DOMICI. EM ESTADOS NÃO MEMBROS DA EU						
						1 183 254
TISHMAN ESO	91 579	0.06	EUR	0.06		5 366
ISHARES TREASURY B	48 702	26.58	USD	24.19		1 177 888
						22 532 036
OUTROS ACTIVOS						
Imóveis						
R Rodrigo Fonseca	5	448 540.00	EUR	448 540.00		2 242 700
REPUBLICA 35- R/C	8	625 512.50	EUR	625 512.50		5 004 100
						7 246 800
						7 246 800
LIQUIDEZ						
À VISTA						
						5 873 091
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			275
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			203
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			5 856 919
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			4 281
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			93
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			400
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			10 921

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2019-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
						5 873 091
						5 873 091
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
VALORES ACTIVOS						1 591
VALORES PASSIVOS						-254 890
						-253 299
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						114 282 831
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					8 475 162.09	
Valor da Unidade de Participação:		€ 13.4844				