

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-11-30

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.						57 400
Ações						
EDP Renováveis	3 232	17.76	EUR	17.76		57 400
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					126 288	79 141 417
Títulos de Dívida Pública						
DBR 2.5% 01/2021	1 000 000	100.29%	EUR	100.29%	22 678	1 025 598
DBR 1.5% 02/2023	2 832 000	105.06%	EUR	105.06%	33 659	3 008 902
FRTR 4.25% 10/2023	300 000	114.56%	EUR	114.56%	1 292	344 972
FRTR 3% 04/2022	1 700 000	105.18%	EUR	105.18%	30 740	1 818 732
FRTR 0.25% 11/26	4 740 000	105.09%	EUR	105.09%	195	4 981 366
SPGB 1.95% 07/2030	300 000	118.44%	EUR	118.44%	1 987	357 304
SPGB 3.45% 07/66	480 000	181.07%	EUR	181.07%	5 626	874 762
SPGB 0.45% 10/22	1 800 000	102.01%	EUR	102.01%	688	1 836 868
BTPS 4% 2/2037	300 000	143.34%	EUR	143.34%	3 978	434 010
BTPS 2% 12/2025	300 000	110.07%	EUR	110.07%	3 000	333 198
BTPS 3.45% 03/48	1 136 000	145.48%	EUR	145.48%	9 852	1 662 516
CCTS Float 07/2023	1 300 000	101.28%	EUR	101.28%	1 847	1 318 487
RAGB 0.75% 10/26	600 000	108.18%	EUR	108.18%	518	649 622
RAGB 0% 07/2023	2 000 000	101.83%	EUR	101.83%		2 036 580
IRISH 0% 10/22	400 000	101.26%	EUR	101.26%		405 024
						21 087 941
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
KFW 0% 04/2024	500 000	102.17%	EUR	102.17%		510 845
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	600 000	99.59%	EUR	99.59%		597 528
VW Float 07/21	200 000	100.07%	EUR	100.07%		200 148
SAPGR Float 03/21	300 000	100.07%	EUR	100.07%		300 195
VW Float 12/21	1 700 000	100.24%	EUR	100.24%	861	1 704 890
DB Float 12/2020	1 700 000	100.00%	EUR	100.00%	80	1 700 097
PBBGR Float 07/28/23	1 000 000	99.94%	EUR	99.94%	369	999 779
ACAAP Float 04/22	1 500 000	100.89%	EUR	100.89%	509	1 513 874
BNP Float 06/24	1 000 000	101.05%	EUR	101.05%	638	1 011 158
RENAUL Float 03/2022	400 000	99.95%	EUR	99.95%	158	399 974
GFCFP Float 06/22	500 000	100.12%	EUR	100.12%		500 575
RENAULT Float 11/24	400 000	97.13%	EUR	97.13%	15	388 519
BNP Float 05/23	300 000	100.74%	EUR	100.74%	6	302 217
SOCGEN FLT 14/01/21	500 000	100.06%	EUR	100.06%		500 295
ACAAP Float 01/2022	600 000	100.54%	EUR	100.54%	31	603 283
CAFP Float 09/2023	1 900 000	100.39%	EUR	100.39%	667	1 908 115
HSBC Float 09/22	100 000	100.45%	EUR	100.45%	37	100 486
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	100.71%	EUR	100.71%	550	1 007 650
HSBC Float 10/23	1 500 000	100.46%	EUR	100.46%	5	1 506 875
CCE FLOAT 11/21	800 000	100.17%	EUR	100.17%		801 376
RBS Float 09/21	1 200 000	100.59%	EUR	100.59%	868	1 207 900
RBS Float 03/21	500 000	100.11%	EUR	100.11%	155	500 695
IBESM Float 02/24	1 200 000	100.74%	EUR	100.74%	52	1 208 920
SANTAN Float 03/22	1 000 000	101.02%	EUR	101.02%	1 024	1 011 214
BBVASM Float 04/22	1 000 000	100.52%	EUR	100.52%	131	1 005 341

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
 Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2020-11-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
AMSSM Float 03/22	700 000	99.44%	EUR	99.44%		696 094
SANTAN Float 03/23	500 000	100.71%	EUR	100.71%	228	503 788
ISPIM Float 04/22	1 000 000	100.79%	EUR	100.79%	529	1 008 449
FCABNK Float 06/21	500 000	100.07%	EUR	100.07%		500 330
ISPIM Float 02/2021	500 000	100.13%	EUR	100.13%	16	500 646
GS Float 07/2021	200 000	100.59%	EUR	100.59%	95	201 283
MS Float 01/22	300 000	100.09%	EUR	100.09%	55	300 310
WFC Float 01/22	1 400 000	100.40%	EUR	100.40%		1 405 600
BAC Float 02/22	600 000	100.11%	EUR	100.11%	104	600 740
BAC Float 05/23	150 000	100.67%	EUR	100.67%	29	151 030
MS Float 11/22	1 200 000	100.43%	EUR	100.43%	134	1 205 318
GM Float 05/21	800 000	100.01%	EUR	100.01%	78	800 142
BATSLN Float 08/21	500 000	100.05%	EUR	100.05%		500 240
F Float 12/22	300 000	95.88%	EUR	95.88%		287 637
C Float 03/23	1 150 000	100.51%	EUR	100.51%		1 155 819
GM Float 03/22	300 000	99.58%	EUR	99.58%	30	298 764
BAC FLOAT 04/24	800 000	100.57%	EUR	100.57%	151	804 719
T Float 09/23	1 500 000	101.21%	EUR	101.21%	1 364	1 519 469
FIS Float 05/2021	500 000	100.04%	EUR	100.04%		500 185
GS Float 04/2023	500 000	100.23%	EUR	100.23%	23	501 193
SCANIA Float 03/21	200 000	100.04%	EUR	100.04%		200 084
DAIGR Float 05/22	500 000	100.12%	EUR	100.12%		500 620
BAYNGR Float 06/22	1 500 000	100.21%	EUR	100.21%	152	1 503 287
INTNED Float 09/23	600 000	101.57%	EUR	101.57%	413	609 821
INTNED Float 11/21	200 000	100.47%	EUR	100.47%		200 938
ABNANV Flt. 12/21	200 000	100.47%	EUR	100.47%		200 938
INTNED Float 04/22	200 000	100.61%	EUR	100.61%		201 224
ANNGR Float 12/2022	1 600 000	100.21%	EUR	100.21%		1 603 328
NYKRE Float 06/22	700 000	100.42%	EUR	100.42%	163	703 075
NYKRE Flt. 01/24	300 000	100.52%	EUR	100.52%	3	301 556
SPOLNO Float 09/21	200 000	100.32%	EUR	100.32%	10	200 650
DNBNO Flt. 07/22	600 000	101.07%	EUR	101.07%	143	606 545
CBSBKF Float 03/21	400 000	100.08%	EUR	100.08%	16	400 336
KBCBB Float 11/22	1 600 000	100.68%	EUR	100.68%	7	1 610 823
ABIBB Float 04/24	1 600 000	100.33%	EUR	100.33%		1 605 328
DLTAS 2008-1 A	343 992	99.71%	EUR	99.71%		342 994
DHR Float 06/22	950 000	100.14%	EUR	100.14%		951 292
DE FLOAT 10/22	2 100 000	100.18%	EUR	100.18%		2 103 696
SUMIBK Float 06/22	1 500 000	100.45%	EUR	100.45%		1 506 675
MUFG Float 05/2023	1 400 000	100.43%	EUR	100.43%	1	1 406 077
CBAAU Float 03/2023	700 000	100.74%	EUR	100.74%	28	705 187
BMO Float 03/22	200 000	100.49%	EUR	100.49%	5	200 975
GS Float 07/2022	600 000	101.13%	EUR	101.13%	293	607 091
GE FLOAT 5/21	1 700 000	100.00%	EUR	100.00%		1 700 000
						54 395 400
Ações						
BMW	754	73.04	EUR	73.04		55 072
DEUTSCHE BANK	5 199	9.34	EUR	9.34		48 574
SIEMENS	1 037	112.00	EUR	112.00		116 144
ALLIANZ	225	197.66	EUR	197.66		44 474
E.ON AG(EX VEBA AG)	2 127	9.08	EUR	9.08		19 305

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-11-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BASF	910	61.33	EUR	61.33		55 810
BAYER AG	1 888	48.27	EUR	48.27		91 134
ADIDAS- SALOMON AG	153	267.30	EUR	267.30		40 897
SAP SE	933	101.98	EUR	101.98		95 147
DEUTSCHE TELEKOM	4 801	15.12	EUR	15.12		72 567
DAIMLER CHRYSLER	528	56.45	EUR	56.45		29 806
INFINEON TECHNOLOGIE	1 381	29.52	EUR	29.52		40 767
DEUTSCHE POST	2 050	40.50	EUR	40.50		83 025
FRESENIUS SE&CO KGAA	753	37.50	EUR	37.50		28 238
SIEMENS HEALTHIN	727	38.55	EUR	38.55		28 026
Siemens Energy AG	519	24.90	EUR	24.90		12 923
DANONE	889	53.86	EUR	53.86		47 882
AXA-UAP	939	19.71	EUR	19.71		18 510
PERNOD RICARD	300	160.00	EUR	160.00		48 000
TOTAL SE	2 531	35.83	EUR	35.83		90 673
L OREAL	304	306.80	EUR	306.80		93 267
Kering	82	605.00	EUR	605.00		49 610
PEUGEOT CITROEN	1 879	19.77	EUR	19.77		37 138
BNP	1 766	42.97	EUR	42.97		75 876
AIR LIQUIDE	453	137.65	EUR	137.65		62 355
SCHNEIDER	293	116.65	EUR	116.65		34 178
L.V.M.H.	317	482.90	EUR	482.90		153 079
MICHELIN	173	104.45	EUR	104.45		18 070
SAINT-GOBAIN	853	39.82	EUR	39.82		33 966
BOUYGUES	572	33.38	EUR	33.38		19 093
EssilorLuxottica	285	121.35	EUR	121.35		34 585
GLE ENTREP. VINCI	610	85.50	EUR	85.50		52 155
DASSAULT SYSTEMES	128	155.05	EUR	155.05		19 846
SANOFI SYNHLABO	1 061	84.71	EUR	84.71		89 877
AIRBUS SE	729	87.73	EUR	87.73		63 955
CREDIT AGRICOLE SA	3 749	9.67	EUR	9.67		36 268
ILIAD SA	204	170.20	EUR	170.20		34 721
SAFRAN SA	177	122.30	EUR	122.30		21 647
HERMES INTERNACIONAL	30	817.40	EUR	817.40		24 522
TELEPERFORMANCE	78	279.20	EUR	279.20		21 778
UNILEVER	2 440	45.71	GBP	51.02		124 489
RECKITT BENCKISER	300	65.84	GBP	73.49		22 047
ANGLO AMERICAN PLC	826	22.14	GBP	24.71		20 408
OCADO GROUP PLC	1 134	22.07	GBP	24.63		27 935
AMADEUS HOLDING SA	426	57.46	EUR	57.46		24 478
TELEFONICA	3 973	3.66	EUR	3.66		14 529
BCO SANTANDER C.HISP	23 692	2.42	EUR	2.42		57 275
IBERDROLA	4 548	11.45	EUR	11.45		52 052
REPSOL	1 620	8.06	EUR	8.06		13 054
FERROVIAL	627	23.32	EUR	23.32		14 622
INDITEX	1 672	27.85	EUR	27.85		46 565
TELECOM ITALIA	46 811	0.39	EUR	0.39		18 373
UNICREDITO ITALIANO	4 902	8.64	EUR	8.64		42 368
ENI SPA	1 345	8.30	EUR	8.30		11 168
ENEL	6 378	8.37	EUR	8.37		53 384
ESSITY AKTIEBO-B	847	271.90	SEK	26.59		22 519
ASML NA	476	363.85	EUR	363.85		173 193

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-11-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
AKZO NOBEL NV NLG20	408	89.06	EUR	89.06		36 336
DSM NV	278	137.30	EUR	137.30		38 169
FIAT CHRYSLER AUTOM	1 370	13.07	EUR	13.07		17 900
Prosus NV	523	90.84	EUR	90.84		47 509
NOKIA A	3 881	3.35	EUR	3.35		12 992
SAMPO OYJ-A SHS	1 645	36.23	EUR	36.23		59 598
Neste Oyj	445	56.18	EUR	56.18		25 000
KBC BANKVERZEKERING	970	58.40	EUR	58.40		56 648
ERST BK DER OEST.SPA	1 766	24.10	EUR	24.10		42 561
CRH ORD	811	32.82	EUR	32.82		26 617
						3 144 750
Direitos						
BCO SANT C. DIR INC	23 692	0.10	EUR	0.10		2 481
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					792	4 587 853
Títulos de Dívida Pública						
KOREA 0% 09/2025	200 000	101.11%	EUR	101.11%		202 218
Obrigações diversas						
F Float 12/21	1 000 000	98.59%	EUR	98.59%		985 940
F Float 05/21	250 000	99.47%	EUR	99.47%		248 685
UBS Float 09/22	1 500 000	100.44%	EUR	100.44%	589	1 507 249
TACHEM Float 11/22	1 600 000	101.36%	EUR	101.36%	204	1 621 948
						4 363 821
Ações						
ZURICH ALLIED AG	64	368.90	CHF	340.83		21 813
						83 786 670
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						12 009 411
CXG IMOBILIARIO	710 909	4.03	EUR	4.03		2 868 020
CAIXA PRIVATE EQUITY	40 509	5.59	EUR	5.59		226 441
CXG INFRAESTRUTURAS	79 838	7.43	EUR	7.43		593 069
Fundimo	1 048 175	7.94	EUR	7.94		8 321 881
OIC DOMICILIADOS NUM ESTADO-MEMBRO DA EU						13 585 096
ALLIANZ EUROLD EQY G	227	3 215.98	EUR	3 215.98		730 027
SCHRODER ISF EURO EQ	71 871	45.79	EUR	45.79		3 290 750
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	2 279.20	EUR	2 279.20		2 384 043
AMUNDI CASH INST SRI	3	217 360.10	EUR	217 360.10		652 080
EAST-US CB-CE HG	76 489	12.19	EUR	12.19		932 171
PGIS-CR BD-IN€HA	81 624	11.55	EUR	11.55		942 757
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	33 565	38.93	EUR	38.93		1 306 685
AB SCV I-EUZ EQ I	114 413	29.25	EUR	29.25		3 346 580
OIC DOMICI. EM ESTADOS NÃO MEMBROS DA EU						2 150
TISHMAN ESOF	91 579	0.02	EUR	0.02		2 150
						25 596 656
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 2020-11-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
LIQUIDEZ						
À VISTA						4 009 235
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			517
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			67
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			3 253 598
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			246 318
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			1 843
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			87
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			395
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			3 923
DO SANTANDER US 0.0000%			USD			502 487
						4 009 235
						4 009 235
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
VALORES ACTIVOS						131 505
VALORES PASSIVOS						-263 222
						-131 717
						120 534 845
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
VGZO EUR EUX 12/20	18	3 492.00	EUR	3 492.00		628 560
ESZO S&P500 12/20	4	3 609.00	USD	3 020.84		604 168
						1 232 728
						1 232 728
						1 232 728
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO						8 755 429.16
Valor da Unidade de Participação:		€ 13.7669				