

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2019-12-31

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.						24 801
Ações						
EDP Renováveis	2 362	10.50	EUR	10.50		24 801
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					136 787	78 115 151
Títulos de Dívida Pública						
DBR 2.5% 01/2021	400 000	103.27%	EUR	103.27%	9 918	423 014
DBR 1.5% 02/2023	1 722 000	106.50%	EUR	106.50%	22 645	1 856 627
DBR 1.25% 08/48	430 000	125.47%	EUR	125.47%	2 041	541 571
FRTR 4.25% 10/2023	2 150 000	118.24%	EUR	118.24%	16 977	2 559 223
FRTR 3% 04/2022	777 000	108.36%	EUR	108.36%	15 986	857 951
FRTR 0.25% 11/26	2 340 000	102.77%	EUR	102.77%	591	2 405 480
FRTR 2% 05/48	50 000	128.45%	EUR	128.45%	604	64 827
SPGB 1.95% 07/2030	100 000	114.57%	EUR	114.57%	826	115 395
SPGB 3.45% 07/66	430 000	158.57%	EUR	158.57%	6 283	688 146
SPGB 0.45% 10/22	2 969 000	102.20%	EUR	102.20%	2 263	3 036 433
BTPS 4% 2/2037	2 250 000	128.66%	EUR	128.66%	37 418	2 932 201
BTPS 2% 12/2025	1 302 000	106.96%	EUR	106.96%	2 206	1 394 760
BOTS 0% 10/2020	1 008 000	100.16%	EUR	100.16%		1 009 593
T 2.515% 01/2020	290 000	97.61%	USD	97.61%	5 481	257 631
NETHER 0.75% 07/28	765 000	107.60%	EUR	107.60%	2 665	825 820
RAGB 0.75% 10/26	557 000	106.32%	EUR	106.32%	833	593 052
RAGB 0% 07/2023	765 000	101.66%	EUR	101.66%		777 730
IRISH 0% 10/22	400 000	101.15%	EUR	101.15%		404 600
CCTS Float 12/20	1 300 000	100.55%	EUR	100.55%	282	1 307 445
						22 051 498
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	400 000	101.09%	EUR	101.09%		404 340
KFW 0% 04/2024	500 000	101.20%	EUR	101.20%		505 995
						910 335
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	600 000	99.50%	EUR	99.50%	33	597 021
VW Float 07/21	200 000	99.99%	EUR	99.99%	12	199 994
SAPGR Float 03/21	300 000	100.24%	EUR	100.24%		300 711
VW Float 12/21	1 200 000	100.44%	EUR	100.44%	234	1 205 526
CMZB Float 12/20	300 000	100.29%	EUR	100.29%	12	300 879
SAPGR Float 12/2020	200 000	100.22%	EUR	100.22%		200 434
DB Float 12/2020	1 700 000	99.76%	EUR	99.76%	114	1 696 102
ACAFP Float 04/22	1 500 000	101.02%	EUR	101.02%	1 170	1 516 425
BNP Float 06/24	1 000 000	101.06%	EUR	101.06%	227	1 010 867
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.02%	EUR	100.02%	49	400 145
GFCFP Float 06/22	500 000	100.32%	EUR	100.32%		501 575
RENAULT Float 11/24	400 000	97.02%	EUR	97.02%	113	388 177
ALDFP Float 11/20	300 000	100.18%	EUR	100.18%	8	300 533
BNP Float 05/23	300 000	100.52%	EUR	100.52%	71	301 634
SOCGEN FLT.062%01/21	500 000	100.25%	EUR	100.25%		501 245
ACAFP Float 01/2022	600 000	100.67%	EUR	100.67%	167	604 205
CAFP Float 09/2023	1 400 000	100.03%	EUR	100.03%	200	1 400 634
HSBC Float 09/22	350 000	100.52%	EUR	100.52%	15	351 838

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63, 1000-300, LISBOA
 Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2019-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
RBS Float 06/20	1 000 000	100.06%	EUR	100.06%	22	1 000 622
LLOYDS Float 06/2024	500 000	100.83%	EUR	100.83%	48	504 218
HSBC Float 10/23	1 500 000	99.98%	EUR	99.98%	269	1 499 969
CCE FLOAT 11/21	800 000	100.33%	EUR	100.33%		802 632
RBS Float 03/2020	200 000	100.03%	EUR	100.03%	1	200 051
RBS Float 03/21	500 000	100.18%	EUR	100.18%	85	501 005
IBESM Float 02/24	700 000	100.63%	EUR	100.63%	218	704 635
SANTAN Float 03/22	1 000 000	101.02%	EUR	101.02%	156	1 010 306
BBVASM Float 04/22	1 000 000	100.72%	EUR	100.72%	399	1 007 629
AMSSM Float 03/22	700 000	100.18%	EUR	100.18%	15	701 268
SCANIA Float 04/20	200 000	100.04%	EUR	100.04%		200 078
FCABNK Float 06/21	500 000	99.90%	EUR	99.90%		499 510
ISPIM Float 02/2021	500 000	100.56%	EUR	100.56%	314	503 089
GS Float 07/2021	700 000	101.17%	EUR	101.17%	753	708 922
MS Float 01/22	300 000	100.39%	EUR	100.39%	160	301 315
WFC Float 01/22	1 400 000	100.30%	EUR	100.30%	229	1 404 471
BAC Float 02/22	600 000	100.42%	EUR	100.42%	364	602 866
BAC Float 05/23	150 000	100.78%	EUR	100.78%	93	151 266
GM Float 05/21	800 000	100.25%	EUR	100.25%	317	802 293
BATSLN Float 08/21	500 000	100.07%	EUR	100.07%	62	500 417
C Float 03/23	500 000	100.22%	EUR	100.22%	13	501 128
GM Float 03/22	300 000	99.37%	EUR	99.37%	6	298 119
BAC FLOAT 04/24	800 000	100.57%	EUR	100.57%	450	805 034
T Float 09/23	1 000 000	101.39%	EUR	101.39%	350	1 014 250
NDASS Float 09/21	400 000	100.62%	EUR	100.62%	6	402 466
UBS Float 04/2021	500 000	100.47%	EUR	100.47%	89	502 449
SCANIA Float 03/21	200 000	100.10%	EUR	100.10%	4	200 198
DAIGR Float 05/22	100 000	99.86%	EUR	99.86%		99 861
MYL Float 05/20	200 000	99.97%	EUR	99.97%	19	199 967
DAIGR Float 04/20	200 000	100.08%	EUR	100.08%	36	200 200
TOYOTA FLT 04/27	500 000	100.06%	EUR	100.06%		500 295
BAYNGR Float 06/22	1 500 000	100.21%	EUR	100.21%	31	1 503 106
INTNED Float 09/23	600 000	101.40%	EUR	101.40%	89	608 495
INTNED Float 11/21	200 000	100.50%	EUR	100.50%	3	200 993
ABNANV Flt. 12/21	200 000	100.34%	EUR	100.34%		200 686
ABNANV Flt.092%01/21	200 000	100.26%	EUR	100.26%		200 510
INTNED Float 04/22	200 000	100.51%	EUR	100.51%		201 014
ANNGR Float 12/2022	1 600 000	100.07%	EUR	100.07%	21	1 601 077
NYKRE Float 06/22	700 000	99.95%	EUR	99.95%	101	699 758
JYBC Float 06/20	400 000	100.09%	EUR	100.09%		400 340
NYKRE Flt. 01/24	300 000	101.13%	EUR	101.13%	67	303 453
SPOLNO Float 09/21	200 000	100.14%	EUR	100.14%	3	200 283
DNBNO Flt. 07/22	600 000	101.17%	EUR	101.17%	394	607 402
CBSBKF Float 03/21	400 000	100.16%	EUR	100.16%	27	400 657
KBCBB Float 11/22	1 400 000	100.70%	EUR	100.70%	204	1 409 990
ABIBB Float 04/24	700 000	99.74%	EUR	99.74%		698 152
DLTAS 2008-1 A	474 344	99.90%	EUR	99.90%	12	473 882
DHR Float 06/22	950 000	99.94%	EUR	99.94%		949 459
DE Float 09/20	100 000	100.16%	EUR	100.16%		100 163
DE FLOAT 10/22	2 100 000	100.07%	EUR	100.07%		2 101 512
SUMIBK Float 06/22	1 500 000	100.27%	EUR	100.27%	37	1 504 147

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2019-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
NAB Float 04/2021	300 000	100.60%	EUR	100.60%	96	301 881
CBAAU Float 03/2023	700 000	100.77%	EUR	100.77%	47	705 423
BMO Float 09/21	200 000	100.58%	EUR	100.58%	1	201 165
BMO Float 03/22	200 000	100.52%	EUR	100.52%	9	201 041
CAFP Float 03/2020	800 000	100.05%	EUR	100.05%	26	800 394
DE Float 04/20	300 000	100.08%	EUR	100.08%		300 231
GS Float 07/2022	600 000	101.68%	EUR	101.68%	646	610 714
GS Float 29/05/2020	500 000	100.22%	EUR	100.22%	138	501 243
SAPGR Float 04/2020	200 000	100.06%	EUR	100.06%		200 128
GE FLOAT 5/21	1 700 000	99.82%	EUR	99.82%		1 696 957
UCGIM Float 02/2020	750 000	100.09%	EUR	100.09%	534	751 171
DNBNO Float 01/2020	400 000	100.01%	EUR	100.01%		400 048
RABOBK Float 05/2020	300 000	100.14%	EUR	100.14%		300 423
ISPIM Float 06/20	1 300 000	100.35%	EUR	100.35%	378	1 304 863
						52 749 235
Ações						
BMW	279	73.14	EUR	73.14		20 406
DEUTSCHE BANK	4 068	6.92	EUR	6.92		28 138
SIEMENS	661	116.54	EUR	116.54		77 033
ALLIANZ	177	218.40	EUR	218.40		38 657
E.ON AG (EX VEBA AG)	1 554	9.52	EUR	9.52		14 800
BASF	423	67.35	EUR	67.35		28 489
BAYER AG	952	72.81	EUR	72.81		69 315
ADIDAS- SALOMON AG	149	289.80	EUR	289.80		43 180
SAP SE	682	120.32	EUR	120.32		82 058
DEUTSCHE TELEKOM	1 499	14.57	EUR	14.57		21 840
DAIMLER CHRYSLER	715	49.37	EUR	49.37		35 300
INFINEON TECHNOLOGIE	1 527	20.31	EUR	20.31		31 013
DEUTSCHE POST	900	34.01	EUR	34.01		30 609
PORSCHE AG-PFD	189	66.64	EUR	66.64		12 595
VOLKSWAGEN AG-PREF.	172	176.24	EUR	176.24		30 313
CONTINENTAL AG	82	115.26	EUR	115.26		9 451
TELEFONICA DEUTSCH H	6 509	2.58	EUR	2.58		16 819
FRESENTIUS SE&CO KGAA	401	50.18	EUR	50.18		20 122
WIRECARD AG	213	107.50	EUR	107.50		22 898
COVESTRO AG	478	41.45	EUR	41.45		19 813
SIEMENS HEALTHIN	455	42.82	EUR	42.82		19 483
GEN DES EAUX/VIVENDI	470	25.82	EUR	25.82		12 135
DANONE	650	73.90	EUR	73.90		48 035
AXA-UAP	686	25.11	EUR	25.11		17 225
PERNOD RICARD	219	159.40	EUR	159.40		34 909
TOTAL SA	1 240	49.20	EUR	49.20		61 008
L OREAL	222	264.00	EUR	264.00		58 608
Kering	60	585.20	EUR	585.20		35 112
BNP	1 376	52.83	EUR	52.83		72 694
AIR LIQUIDE	116	126.20	EUR	126.20		14 639
SCHNEIDER	490	91.50	EUR	91.50		44 835
L.V.M.H.	222	414.20	EUR	414.20		91 952
MICHELIN	126	109.10	EUR	109.10		13 747
SAINT-GOBAIN	505	36.50	EUR	36.50		18 433
THOMSON	113	92.52	EUR	92.52		10 455

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2019-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
RENAULT SA	178	42.18	EUR	42.18		7 508
EssilorLuxottica	208	135.80	EUR	135.80		28 246
ORANGE	223	13.12	EUR	13.12		2 926
GLE ENTREP. VINCI	523	99.00	EUR	99.00		51 777
SANOFI SYNHLABO	696	89.62	EUR	89.62		62 376
AIRBUS SE	450	130.48	EUR	130.48		58 716
CREDIT AGRICOLE SA	2 950	12.93	EUR	12.93		38 129
ILIAD SA	120	115.55	EUR	115.55		13 866
SAFRAN SA	292	137.65	EUR	137.65		40 194
HERMES INTERNACIONAL	22	666.20	EUR	666.20		14 656
RECKITT BENCKISER	219	61.29	GBP	72.43		15 862
ANGLO AMERICAN PLC	763	21.73	GBP	25.68		19 594
OCADO GROUP PLC	1 469	12.79	GBP	15.11		22 204
TELEFONICA	2 903	6.23	EUR	6.23		18 077
BCO SANTANDER C.HISP	4 527	3.73	EUR	3.73		16 886
IBERDROLA	3 324	9.18	EUR	9.18		30 514
REPSOL	1 704	13.93	EUR	13.93		23 737
INDITEX	915	31.45	EUR	31.45		28 777
Aena SME SA	83	170.50	EUR	170.50		14 152
TELECOM ITALIA	34 178	0.56	EUR	0.56		19 017
UNICREDITO ITALIANO	3 857	13.02	EUR	13.02		50 218
ENEL	4 661	7.07	EUR	7.07		32 963
ATLANTIA SPA	516	20.79	EUR	20.79		10 728
ESSITY AKTIEBO-B	619	301.80	SEK	28.77		17 806
ING GROEP NV	5 363	10.69	EUR	10.69		57 320
ASML NA	397	263.70	EUR	263.70		104 689
AKZO NOBEL NV NLG20	379	90.64	EUR	90.64		34 353
DSM NV	340	116.10	EUR	116.10		39 474
FIAT CHRYSLER AUTOM	845	13.19	EUR	13.19		11 149
UNILEVER NV	1 783	51.23	EUR	51.23		91 343
SAMPO OYJ-A SHS	1 270	38.91	EUR	38.91		49 416
Neste Oyj	1 115	31.02	EUR	31.02		34 587
KONE OYJ-B	317	58.28	EUR	58.28		18 475
KBC BANKVERZEKERING	757	67.06	EUR	67.06		50 764
ERST BK DER OEST.SPA	1 380	33.56	EUR	33.56		46 313
CRH ORD	593	35.67	EUR	35.67		21 152
						2 404 082
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					890	4 772 152
Obrigações diversas						
F Float 12/21	1 000 000	98.02%	EUR	98.02%		980 160
F Float 05/21	250 000	99.22%	EUR	99.22%	11	248 071
UBS Float 09/22	1 500 000	100.55%	EUR	100.55%	149	1 508 384
AGM Float 11/20	100 000	100.02%	EUR	100.02%		100 022
SUMIBK Float 09/20	100 000	100.25%	EUR	100.25%	1	100 250
TACHEM Float 11/22	700 000	102.00%	EUR	102.00%	552	714 559
TACHEM Float 11/20	1 100 000	100.31%	EUR	100.31%	178	1 103 533
						4 754 978
Ações						
ZURICH ALLIED AG	47	397.10	CHF	365.39		17 174
						82 912 103

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2019-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						
CXG IMOBILIARIO	710 909	4.01	EUR	4.01		7 261 525
						2 847 262
CAIXA PRIVATE EQUITY	40 509	5.55	EUR	5.55		225 011
CXG INFRAESTRUTURAS	77 407	8.01	EUR	8.01		619 875
Fundimo	466 982	7.64	EUR	7.64		3 569 377
OIC DOMICILIADOS NUM ESTADO-MEMBRO DA EU						
ALLIANZ EUOLD EQY G	86	2 896.72	EUR	2 896.72		15 050 662
JANUS HEND H. PAN AL	8 862	17.44	EUR	17.44		249 118
SCHRODER ISF EURO EQ	51 444	46.80	EUR	46.80		154 553
MERRILL LYNCH MARSH	2 380	136.39	EUR	136.39		2 407 620
JAN HND UK ABS RET	47 051	7.17	EUR	7.17		324 608
MERIAN GLOBAL INVEST	134 786	1.38	EUR	1.38		337 285
SCH EUROP ALPHA ABS	2 182	95.00	EUR	95.00		185 506
LYXOR EPSILON GLOB E	1 423	133.34	EUR	133.34		207 299
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	2 047.33	EUR	2 047.33		189 738
AMUNDI CASH INST SRI	9	218 153.30	EUR	218 153.30		2 141 507
JANUS HEND HORIZ EUR	154 068	15.39	EUR	15.39		1 963 380
LFIS-VIS PR-M€A	574	1 044.17	EUR	1 044.17		2 371 107
DNCA INVEST-MIURA-I	917	116.29	EUR	116.29		599 354
MLIS PSAM GL EV UC A	1 951	138.53	EUR	138.53		106 638
AM-EURL EQ-I2EC	234 077	10.30	EUR	10.30		270 257
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	15 052	38.47	EUR	38.47		2 410 993
XUS TREASURY €	4 697	117.66	EUR	117.66		579 050
OIC DOMICL. EM ESTADOS NÃO MEMBROS DA EU						
TISHMAN ESOF	91 579	0.05	EUR	0.05		552 649
ISHARES TREASURY B	48 702	25.94	USD	23.10		1 129 915
						4 706
						1 125 209
						23 442 102
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						
Depósitos à ordem						6 134 136
DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			275
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			201
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			5 965 954
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			128 297
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			5 720
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			94
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			673
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			18 220
DO SANTANDER US 0.0000%			USD			14 703
						6 134 136
						6 134 136

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2019-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
VALORES ACTIVOS						137 475
VALORES PASSIVOS						-399 118
						-261 643
						119 500 699
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
VGH0 EUR EUX 03/20	32	3 729.00	EUR	3 729.00		1 193 280
ESH0 S&P500 03/20	-8	3 216.25	USD	2 865.00		-1 146 000
						47 280
						47 280
						47 280
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					8 832 465.11	
Valor da Unidade de Participação: € 13.5297						