

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-12-31

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.						73 690
Ações						
EDP Renováveis	3 232	22.80	EUR	22.80		73 690
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					119 354	80 914 644
Títulos de Dívida Pública						
DBR 2.5% 01/2021	1 000 000	100.00%	EUR	100.00%	24 795	1 024 815
DBR 1.5% 02/2023	982 000	104.80%	EUR	104.80%	12 919	1 042 016
BKO 0% 09/2021	1 000 000	100.47%	EUR	100.47%		1 004 730
FRTR 4.25% 10/2023	300 000	114.16%	EUR	114.16%	2 375	344 843
FRTR 3% 04/2022	1 700 000	104.84%	EUR	104.84%	35 071	1 817 334
FRTR 0.25% 11/26	4 740 000	105.10%	EUR	105.10%	1 201	4 982 989
SPGB 1.95% 07/2030	300 000	118.63%	EUR	118.63%	2 484	358 380
SPGB 3.45% 07/66	480 000	181.10%	EUR	181.10%	7 032	876 312
SPGB 0.45% 10/22	1 800 000	101.89%	EUR	101.89%	1 376	1 835 396
BTPS 4% 2/2037	300 000	144.60%	EUR	144.60%	4 989	438 783
BTPS 2% 12/2025	2 100 000	110.21%	EUR	110.21%	3 577	2 317 945
BTPS 3.45% 03/48	1 136 000	147.42%	EUR	147.42%	13 208	1 687 843
RAGB 0% 07/2023	1 165 000	101.67%	EUR	101.67%		1 184 456
IRISH 0% 10/22	400 000	101.27%	EUR	101.27%		405 072
CCTS Float 07/2023	1 300 000	101.25%	EUR	101.25%	2 259	1 318 496
						20 639 410
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
KFW 0% 04/2024	500 000	102.12%	EUR	102.12%		510 575
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	600 000	99.77%	EUR	99.77%		598 626
VW Float 07/21	200 000	100.10%	EUR	100.10%		200 194
SAPGR Float 03/21	300 000	100.06%	EUR	100.06%		300 183
VW Float 12/21	1 700 000	100.28%	EUR	100.28%	190	1 704 916
PBBGR Float 07/28/23	1 000 000	100.30%	EUR	100.30%	706	1 003 656
DB Float 05/2022	2 400 000	100.27%	EUR	100.27%	880	2 407 336
ACAAP Float 04/22	1 500 000	100.83%	EUR	100.83%	885	1 513 350
BNP Float 06/24	1 000 000	101.04%	EUR	101.04%	155	1 010 545
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.13%	EUR	100.13%	25	400 561
GFCFP Float 06/22	500 000	100.31%	EUR	100.31%		501 555
RENAULT Float 11/24	400 000	97.64%	EUR	97.64%	32	390 592
BNP Float 05/23	300 000	100.75%	EUR	100.75%	30	302 268
SOCGEN FLT 14/01/21	500 000	100.01%	EUR	100.01%		500 070
ACAAP Float 01/2022	600 000	100.50%	EUR	100.50%	53	603 029
CAFP Float 09/2023	1 900 000	100.41%	EUR	100.41%	99	1 907 851
HSBC Float 09/22	100 000	100.40%	EUR	100.40%	2	100 404
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	100.88%	EUR	100.88%	73	1 008 853
HSBC Float 10/23	1 500 000	100.48%	EUR	100.48%	7	1 507 267
CCE FLOAT 11/21	800 000	100.26%	EUR	100.26%		802 064
RBS Float 09/21	1 200 000	100.52%	EUR	100.52%	36	1 206 312
RBS Float 03/21	500 000	100.07%	EUR	100.07%	31	500 401
IBESM Float 02/24	1 200 000	100.73%	EUR	100.73%	200	1 209 008
SANTAN Float 03/22	1 000 000	100.97%	EUR	100.97%	146	1 009 866
BBVASM Float 04/22	1 000 000	100.52%	EUR	100.52%	212	1 005 382

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
 Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2020-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
AMSSM Float 03/22	700 000	99.64%	EUR	99.64%		697 466
SANTAN Float 03/23	500 000	100.73%	EUR	100.73%	12	503 677
ISPIM Float 04/22	1 000 000	100.73%	EUR	100.73%	911	1 008 191
BACRED Float 05/22	1 000 000	100.56%	EUR	100.56%	340	1 005 890
FCABNK Float 06/21	500 000	100.08%	EUR	100.08%		500 385
ISPIM Float 02/2021	500 000	100.10%	EUR	100.10%	261	500 751
GS Float 07/2021	200 000	100.52%	EUR	100.52%	179	201 211
MS Float 01/22	300 000	100.09%	EUR	100.09%	103	300 361
WFC Float 01/22	1 400 000	100.38%	EUR	100.38%		1 405 278
BAC Float 02/22	600 000	100.05%	EUR	100.05%	250	600 556
BAC Float 05/23	150 000	100.62%	EUR	100.62%	63	150 999
MS Float 11/22	1 200 000	100.41%	EUR	100.41%	323	1 205 195
GM Float 05/21	800 000	100.03%	EUR	100.03%	193	800 401
BATSLN Float 08/21	500 000	100.09%	EUR	100.09%		500 445
F Float 12/22	300 000	96.38%	EUR	96.38%		289 131
C Float 03/23	1 650 000	100.54%	EUR	100.54%		1 658 877
GM Float 03/22	300 000	99.70%	EUR	99.70%	0	299 103
BAC FLOAT 04/24	800 000	100.63%	EUR	100.63%	281	805 337
T Float 09/23	1 500 000	101.31%	EUR	101.31%	380	1 520 075
FIS Float 05/2021	500 000	100.07%	EUR	100.07%		500 365
GS Float 04/2023	500 000	100.20%	EUR	100.20%	41	501 036
SCANIA Float 03/21	200 000	100.04%	EUR	100.04%		200 076
DAIGR Float 05/22	500 000	100.19%	EUR	100.19%		500 930
BAYNGR Float 06/22	1 500 000	100.29%	EUR	100.29%	2	1 504 412
INTNED Float 09/23	600 000	101.56%	EUR	101.56%	57	609 399
INTNED Float 11/21	200 000	100.44%	EUR	100.44%		200 878
ABNANV Flt. 12/21	200 000	100.44%	EUR	100.44%		200 872
INTNED Float 04/22	200 000	100.59%	EUR	100.59%		201 186
ANNGR Float 12/2022	1 600 000	100.32%	EUR	100.32%		1 605 072
NYKRE Float 06/22	700 000	100.40%	EUR	100.40%	26	702 847
NYKRE Flt. 01/24	300 000	100.57%	EUR	100.57%	5	301 703
SPOLNO Float 09/21	200 000	100.28%	EUR	100.28%		200 560
DNBNO Flt. 07/22	600 000	101.02%	EUR	101.02%	267	606 387
CBSBKF Float 03/21	400 000	100.06%	EUR	100.06%		400 248
KBCBB Float 11/22	1 600 000	100.63%	EUR	100.63%	37	1 610 165
ABIBB Float 04/24	1 600 000	100.41%	EUR	100.41%		1 606 512
DLTAS 2008-1 A	333 121	99.78%	EUR	99.78%		332 388
DHR Float 06/22	950 000	100.19%	EUR	100.19%		951 796
DE FLOAT 10/22	2 100 000	100.33%	EUR	100.33%		2 106 825
SUMIBK Float 06/22	1 500 000	100.44%	EUR	100.44%		1 506 555
MUFG Float 05/2023	1 400 000	100.47%	EUR	100.47%	27	1 406 607
CBAAU Float 03/2023	700 000	100.82%	EUR	100.82%		705 719
BMO Float 03/22	200 000	100.46%	EUR	100.46%		200 916
GS Float 07/2022	600 000	101.05%	EUR	101.05%	546	606 846
GE FLOAT 5/21	1 700 000	100.08%	EUR	100.08%		1 701 326
						56 619 243
Ações						
BMW	754	72.23	EUR	72.23		54 461
DEUTSCHE BANK	5 199	8.95	EUR	8.95		46 526
SIEMENS	1 037	117.52	EUR	117.52		121 868
ALLIANZ	225	200.70	EUR	200.70		45 158
E.ON AG(EX VEBA AG)	2 127	9.06	EUR	9.06		19 279
BASF	910	64.72	EUR	64.72		58 895

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
 Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2020-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BAYER AG	1 888	48.16	EUR	48.16		90 917
ADIDAS- SALOMON AG	153	297.90	EUR	297.90		45 579
SAP SE	933	107.22	EUR	107.22		100 036
DEUTSCHE TELEKOM	4 801	14.96	EUR	14.96		71 799
DAIMLER CHRYSLER	528	57.79	EUR	57.79		30 513
INFINEON TECHNOLOGIE	1 381	31.39	EUR	31.39		43 350
DEUTSCHE POST	2 050	40.50	EUR	40.50		83 025
FRESENIUS SE&CO KGAA	753	37.84	EUR	37.84		28 494
SIEMENS HEALTHIN	727	41.98	EUR	41.98		30 519
Siemens Energy AG	519	30.00	EUR	30.00		15 570
DANONE	767	53.76	EUR	53.76		41 234
AXA-UAP	939	19.51	EUR	19.51		18 322
PERNOD RICARD	355	156.80	EUR	156.80		55 664
TOTAL SE	2 531	35.30	EUR	35.30		89 344
L OREAL	355	310.80	EUR	310.80		110 334
Kering	82	594.40	EUR	594.40		48 741
PEUGEOT CITROEN	1 879	22.37	EUR	22.37		42 033
BNP	1 766	43.11	EUR	43.11		76 123
AIR LIQUIDE	453	134.25	EUR	134.25		60 815
SCHNEIDER	293	118.30	EUR	118.30		34 662
L.V.M.H.	317	510.90	EUR	510.90		161 955
MICHELIN	173	104.95	EUR	104.95		18 156
SAINT-GOBAIN	853	37.50	EUR	37.50		31 988
BOUYGUES	572	33.65	EUR	33.65		19 248
EssilorLuxottica	285	127.55	EUR	127.55		36 352
GLE ENTREP. VINCI	610	81.36	EUR	81.36		49 630
DASSAULT SYSTEMES	128	166.15	EUR	166.15		21 267
SANOFI SYNHLABO	1 061	78.70	EUR	78.70		83 501
AIRBUS SE	729	89.78	EUR	89.78		65 450
CREDIT AGRICOLE SA	3 749	10.32	EUR	10.32		38 690
ILIAD SA	204	168.10	EUR	168.10		34 292
SAFRAN SA	177	115.95	EUR	115.95		20 523
HERMES INTERNACIONAL	30	879.60	EUR	879.60		26 388
TELEPERFORMANCE	78	271.30	EUR	271.30		21 161
RECKITT BENCKISER	369	65.42	GBP	73.08		26 966
ANGLO AMERICAN PLC	826	24.25	GBP	27.08		22 371
OCADO GROUP PLC	1 134	22.87	GBP	25.55		28 971
AMADEUS HOLDING SA	426	59.56	EUR	59.56		25 373
TELEFONICA	3 973	3.25	EUR	3.25		12 892
BCO SANTANDER C.HISP	24 722	2.54	EUR	2.54		62 744
IBERDROLA	4 548	11.70	EUR	11.70		53 212
REPSOL	1 620	8.25	EUR	8.25		13 365
FERROVIAL	627	22.60	EUR	22.60		14 170
INDITEX	1 672	26.04	EUR	26.04		43 539
TELECOM ITALIA	46 811	0.38	EUR	0.38		17 666
UNICREDITO ITALIANO	4 902	7.65	EUR	7.65		37 491
ENI SPA	1 345	8.55	EUR	8.55		11 497
ENEL	6 378	8.28	EUR	8.28		52 784
ESSITY AKTIEBO-B	847	264.50	SEK	26.33		22 303
ASML NA	476	397.55	EUR	397.55		189 234
AKZO NOBEL NV NLG20	408	87.86	EUR	87.86		35 847
DSM NV	278	140.80	EUR	140.80		39 142
FIAT CHRYSLER AUTOM	1 370	14.66	EUR	14.66		20 084

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
Prosus NV	523	88.36	EUR	88.36		46 212
NOKIA A	3 881	3.15	EUR	3.15		12 229
SAMPO OYJ-A SHS	1 645	34.57	EUR	34.57		56 868
Neste Oyj	445	59.16	EUR	59.16		26 326
KBC BANKVERZEKERING	970	57.28	EUR	57.28		55 562
ANHEUSER-BUSCH INB	966	57.01	EUR	57.01		55 072
ERST BK DER OEST.SPA	1 766	24.94	EUR	24.94		44 044
CRH ORD	811	34.02	EUR	34.02		27 590
						3 145 415
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					1 117	4 589 389
Títulos de Dívida Pública						
KOREA 0% 09/2025	200 000	101.07%	EUR	101.07%		202 130
Obrigações diversas						
F Float 12/21	1 000 000	98.69%	EUR	98.69%		986 940
F Float 05/21	250 000	99.34%	EUR	99.34%		248 338
UBS Float 09/22	1 500 000	100.39%	EUR	100.39%	73	1 505 938
TACHEM Float 11/22	1 600 000	101.43%	EUR	101.43%	1 044	1 623 940
						4 365 156
Ações						
ZURICH ALLIED AG	64	373.50	CHF	345.37		22 103
						85 577 722
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						12 038 290
CXG IMOBILIARIO	710 909	4.03	EUR	4.03		2 865 674
CAIXA PRIVATE EQUITY	40 509	5.58	EUR	5.58		226 056
CXG INFRAESTRUTURAS	79 838	7.45	EUR	7.45		594 641
Fundimo	1 061 545	7.87	EUR	7.87		8 351 918
OIC DOMICILIADOS NUM ESTADO-MEMBRO DA EU						13 134 308
ALLIANZ EUOLD EQY G	227	3 258.88	EUR	3 258.88		739 766
SCHRODER ISF EURO EQ	65 998	46.46	EUR	46.46		3 066 313
ALLIANZ RCM EUR EQTY	1 046	2 310.19	EUR	2 310.19		2 416 459
AMUNDI CASH INST SRI	3	217 279.50	EUR	217 279.50		651 839
EAST-US CB-CE HG	76 489	12.22	EUR	12.22		934 772
PGIS-CR BD-IN€HA	81 624	11.62	EUR	11.62		948 471
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	33 565	39.18	EUR	39.18		1 315 077
AB SCV I-EUZ EQ I	102 190	29.96	EUR	29.96		3 061 612
OIC DOMICI. EM ESTADOS NÃO MEMBROS DA EU						2 150
TISHMAN ESOF	91 579	0.02	EUR	0.02		2 150
						25 174 748
OUTROS ACTIVOS						
Imóveis						
R Rodrigo Fonseca	5	461 000.00	EUR	461 000.00		2 305 000
REPUBLICA 35- R/C	8	625 075.00	EUR	625 075.00		5 000 600
						7 305 600
						7 305 600

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2020-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
LIQUIDEZ						
À VISTA						3 090 164
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			507
DO DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			56
DO DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			2 304 902
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			267 078
DO DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			1 888
DO DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			78
DO DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			392
DO DO CGD - USD 0.0000%			USD			3 822
DO SANTANDER US 0.0000%			USD			511 440
						3 090 164
						3 090 164
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
VALORES ACTIVOS						112 702
VALORES PASSIVOS						-1 386 561
						-1 273 859
						119 874 375
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
VGH1 EUR EUX 03/21	17	3 550.00	EUR	3 550.00		603 500
ESH1 S&P500 03/21	4	3 723.00	USD	3 044.15		608 831
						1 212 331
						1 212 331
						1 212 331
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO						8 688 029.65
Valor da Unidade de Participação: € 13.7976						