

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2020-03-31

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.						19 248
Ações						
EDP Renováveis	1 753	10.98	EUR	10.98		19 248
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					19 799	11 396 579
Títulos de Dívida Pública						
DBR 2.5% 01/2021	125 000	102.43%	EUR	102.43%	751	128 786
DBR 0.25% 02/2029	100 000	107.07%	EUR	107.07%	31	107 103
FRTR 4.25% 10/2023	380 000	117.10%	EUR	117.10%	7 016	452 000
FRTR 0.25% 11/26	650 000	103.03%	EUR	103.03%	568	670 276
FRTR 2% 05/48	100 000	131.81%	EUR	131.81%	1 705	133 517
SPGB 1.95% 07/2030	20 000	112.52%	EUR	112.52%	262	22 766
SPGB 3.45% 07/66	130 000	153.48%	EUR	153.48%	3 015	202 541
SPGB 0.45% 10/22	900 000	101.39%	EUR	101.39%	1 693	914 194
BTPS 4% 2/2037	300 000	127.17%	EUR	127.17%	1 978	383 491
BTPS 3.45% 03/48	120 000	121.03%	EUR	121.03%	349	145 585
RAGB 0.75% 10/26	300 000	106.32%	EUR	106.32%	1 008	319 974
IRISH 0% 10/22	60 000	100.97%	EUR	100.97%		60 582
CCTS Float 12/20	100 000	100.00%	EUR	100.00%	138	100 142
						3 640 958
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
KFW 0% 04/2024	250 000	101.02%	EUR	101.02%		252 560
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	200 000	92.94%	EUR	92.94%	33	185 917
SAPGR Float 03/21	200 000	99.67%	EUR	99.67%		199 332
VW Float 12/21	200 000	98.07%	EUR	98.07%	30	196 168
DB Float 12/2020	300 000	98.65%	EUR	98.65%	6	295 968
PBBGR Float 07/28/23	200 000	97.72%	EUR	97.72%	172	195 608
BNP Float 09/22	100 000	96.24%	EUR	96.24%	11	96 250
SOCGEN Float 04/22	100 000	97.07%	EUR	97.07%	116	97 189
ACAFP Float 04/22	100 000	96.62%	EUR	96.62%	81	96 701
RENAUL Float 03/2022	200 000	96.71%	EUR	96.71%	16	193 434
GFCFP Float 06/22	200 000	99.25%	EUR	99.25%	0	198 492
RENAULT Float 11/24	50 000	87.23%	EUR	87.23%	14	43 628
CAFP Float 06/22	100 000	99.10%	EUR	99.10%	6	99 106
ACAFP Float 01/2022	100 000	98.07%	EUR	98.07%	33	98 103
CAFP Float 09/2023	100 000	97.23%	EUR	97.23%	9	97 243
HSBC Float 09/22	100 000	95.85%	EUR	95.85%	5	95 852
LLOYDS Float 06/2024	100 000	92.80%	EUR	92.80%	10	92 810
HSBC Float 10/23	100 000	93.05%	EUR	93.05%	29	93 079
RBS Float 09/21	100 000	98.33%	EUR	98.33%	7	98 337
RBS Float 03/21	100 000	98.83%	EUR	98.83%	15	98 842
IBESM Float 02/24	200 000	98.58%	EUR	98.58%	61	197 212
AMSSM Float 03/22	200 000	97.59%	EUR	97.59%	3	195 179
SANTAN Float 03/23	200 000	94.80%	EUR	94.80%	4	189 610
ISPIM Float 04/22	100 000	96.81%	EUR	96.81%	111	96 918
FCABNK Float 06/21	100 000	98.56%	EUR	98.56%		98 562
ISPIM Float 02/2021	100 000	99.05%	EUR	99.05%	62	99 108
WFC Float 01/22	100 000	96.35%	EUR	96.35%	17	96 369

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2020-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BAC Float 05/23	100 000	94.97%	EUR	94.97%	61	95 028
GM Float 05/21	200 000	96.44%	EUR	96.44%	80	192 962
C Float 03/23	100 000	93.63%	EUR	93.63%	3	93 632
BAC FLOAT 04/24	100 000	92.68%	EUR	92.68%	57	92 741
T Float 09/23	200 000	99.20%	EUR	99.20%	65	198 470
GS Float 04/2023	100 000	93.28%	EUR	93.28%	31	93 314
DT Float 12/2022	200 000	98.77%	EUR	98.77%		197 546
BAYNGR Float 06/22	200 000	98.54%	EUR	98.54%	6	197 080
INTNED Float 09/23	100 000	94.20%	EUR	94.20%	15	94 213
ANNGR Float 12/2022	200 000	98.00%	EUR	98.00%	3	196 011
JYBC Float 12/22	100 000	97.54%	EUR	97.54%	15	97 552
KBCBB Float 11/22	100 000	95.43%	EUR	95.43%	14	95 439
ABIBB Float 04/24	200 000	95.52%	EUR	95.52%		191 034
DLTAS 2008-1 A	47 884	99.80%	EUR	99.80%	1	47 789
DHR Float 06/22	200 000	97.97%	EUR	97.97%		195 940
SUMIBK Float 06/22	200 000	95.86%	EUR	95.86%		191 722
BMO Float 03/22	100 000	97.66%	EUR	97.66%	0	97 659
GS Float 07/2022	75 000	96.61%	EUR	96.61%	83	72 538
GE FLOAT 5/21	200 000	98.79%	EUR	98.79%		197 570
						6 183 256
Ações						
BMW	422	47.12	EUR	47.12		19 883
DEUTSCHE BANK	3 015	5.97	EUR	5.97		17 997
SIEMENS	560	77.47	EUR	77.47		43 383
ALLIANZ	131	156.88	EUR	156.88		20 551
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 154	9.44	EUR	9.44		10 895
BASF	314	43.15	EUR	43.15		13 548
BAYER AG	706	52.85	EUR	52.85		37 312
ADIDAS- SALOMON AG	83	205.90	EUR	205.90		17 090
SAP SE	503	102.80	EUR	102.80		51 708
DEUTSCHE TELEKOM	2 611	11.81	EUR	11.81		30 846
DAIMLER CHRYSLER	814	27.52	EUR	27.52		22 401
INFINEON TECHNOLOGIE	1 141	13.43	EUR	13.43		15 324
DEUTSCHE POST	1 111	24.78	EUR	24.78		27 525
FRESENIUS SE&CO KGAA	297	33.93	EUR	33.93		10 077
WIRECARD AG	158	104.65	EUR	104.65		16 535
COVESTRO AG	352	27.87	EUR	27.87		9 810
SIEMENS HEALTHIN	338	36.05	EUR	36.05		12 183
DANONE	482	58.64	EUR	58.64		28 264
AXA-UAP	509	15.79	EUR	15.79		8 036
PERNOD RICARD	162	129.45	EUR	129.45		20 971
TOTAL SA	1 370	35.39	EUR	35.39		48 484
L OREAL	165	238.90	EUR	238.90		39 419
Kering	44	475.90	EUR	475.90		20 940
PEUGEOT CITROEN	1 000	12.17	EUR	12.17		12 165
BNP	1 020	27.51	EUR	27.51		28 060
AIR LIQUIDE	88	116.65	EUR	116.65		10 265
SCHNEIDER	158	78.58	EUR	78.58		12 416
L.V.M.H.	178	338.45	EUR	338.45		60 244
MICHELIN	94	81.06	EUR	81.06		7 620
SAINT-GOBAIN	462	22.17	EUR	22.17		10 240

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2020-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BOUYGUES	310	26.72	EUR	26.72		8 283
EssilorLuxottica	155	98.28	EUR	98.28		15 233
GLE ENTREP. VINCI	331	75.40	EUR	75.40		24 957
SANOFI SYNHLABO	515	80.14	EUR	80.14		41 272
AIRBUS SE	388	59.34	EUR	59.34		23 024
CREDIT AGRICOLE SA	2 186	6.69	EUR	6.69		14 624
ILIAD SA	110	123.65	EUR	123.65		13 602
SAFRAN SA	96	80.14	EUR	80.14		7 693
HERMES INTERNACIONAL	16	628.80	EUR	628.80		10 061
TELEPERFORMANCE	42	189.80	EUR	189.80		7 972
RECKITT BENCKISER	164	61.50	GBP	69.51		11 399
ANGLO AMERICAN PLC	566	14.16	GBP	16.01		9 061
OCADO GROUP PLC	1 089	12.20	GBP	13.79		15 015
TELEFONICA	2 152	4.17	EUR	4.17		8 981
BCO SANTANDER C.HISP	13 955	2.22	EUR	2.22		30 952
IBERDROLA	2 465	8.98	EUR	8.98		22 146
REPSOL	1 263	8.33	EUR	8.33		10 523
FERROVIAL	340	21.87	EUR	21.87		7 436
INDITEX	905	23.66	EUR	23.66		21 412
TELECOM ITALIA	25 333	0.37	EUR	0.37		9 434
UNICREDITO ITALIANO	2 859	7.15	EUR	7.15		20 433
ENEL	3 460	6.34	EUR	6.34		21 933
ESSITY AKTIEBO-B	459	306.00	SEK	28.01		12 858
ASML NA	294	242.45	EUR	242.45		71 280
AKZO NOBEL NV NLG20	282	60.01	EUR	60.01		16 923
DSM NV	252	103.50	EUR	103.50		26 082
FIAT CHRYSLER AUTOM	907	6.57	EUR	6.57		5 961
UNILEVER NV	1 321	44.81	EUR	44.81		59 187
SAMPO OYJ-A SHS	941	26.62	EUR	26.62		25 049
Neste Oyj	358	30.85	EUR	30.85		11 044
KBC BANKVERZEKERING	561	42.02	EUR	42.02		23 573
ERST BK DER OEST.SPA	1 023	16.89	EUR	16.89		17 273
CRH ORD	440	24.85	EUR	24.85		10 934
						1 319 805
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					80	291 320
Obrigações diversas						
F Float 12/21	100 000	87.02%	EUR	87.02%		87 020
F Float 05/21	100 000	93.69%	EUR	93.69%	2	93 687
TACHEM Float 11/22	100 000	99.20%	EUR	99.20%	78	99 282
						279 989
Ações						
ZURICH ALLIED AG	35	343.40	CHF	323.75		11 331
						11 707 147
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						4 857 665
CXG IMOBILIARIO	182 714	4.03	EUR	4.03		736 593
CAIXA PRIVATE EQUITY	16 936	5.64	EUR	5.64		95 519
CXG INFRAESTRUTURAS	24 178	7.79	EUR	7.79		188 419
FUNDIESTAMO I	58	1 141.01	EUR	1 141.01		66 179
Fundimo	474 898	7.77	EUR	7.77		3 690 955

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2020-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
Fnd I.Imob. MAXIRENT	7 207	11.10	EUR	11.10		80 000
OIC DOMICILIADOS NUM ESTADO-MEMBRO DA EU						8 243 133
ALLIANZ EUOLD EQY G	572	2 322.27	EUR	2 322.27		1 328 338
SCHRODER ISF EURO EQ	66 408	34.50	EUR	34.50		2 291 003
JAN HND UK ABS RET	9 278	7.11	EUR	7.11		65 955
LYXOR EPSILON GLOB E	281	142.62	EUR	142.62		40 077
ALLIANZ RCM EUR EQTY	625	1 642.55	EUR	1 642.55		1 026 594
LFIS-VIS PR-M€A	112	881.60	EUR	881.60		98 739
EAST-US CB-CE HG	17 171	10.86	EUR	10.86		186 391
PGIS-CR BD-IN€HA	17 980	10.22	EUR	10.22		183 756
MLIS PSAM GL EV UC A	380	124.60	EUR	124.60		47 369
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	15 133	32.68	EUR	32.68		494 546
AB SCV I-EUZ EQ I	102 552	21.65	EUR	21.65		2 220 251
XUS TREASURY €	2 035	127.82	EUR	127.82		260 114
						13 100 798
LIQUIDEZ						
À VISTA						1 415 914
Depósitos à ordem						
DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			425
DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			138
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			1 236 623
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			68 495
DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			815
DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			36
DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			298
DO CGD - USD 0.0000%			USD			4 141
DO SANTANDER US 0.0000%			USD			104 943
						1 415 914
						1 415 914
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
VALORES ACTIVOS						99 804
VALORES PASSIVOS						-86 725
						13 079
						26 236 938
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
VGM0 EUR EUX 06/20	19	2 724.00	EUR	2 724.00		517 560
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					4 504 246.06	
Valor da Unidade de Participação:		€ 5.8249				