

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2020-04-30

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.						19 634
Ações						
EDP Renováveis	1 753	11.20	EUR	11.20		19 634
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					19 401	11 147 750
Títulos de Dívida Pública						
DBR 0.5% 08/27	296 000	109.06%	EUR	109.06%	1 051	323 875
DBR 1.25% 08/48	80 000	142.19%	EUR	142.19%	710	114 461
DBR 0.25% 02/2029	100 000	108.13%	EUR	108.13%	52	108 185
FRTR 4.25% 10/2023	380 000	117.07%	EUR	117.07%	8 340	453 187
FRTR 0.25% 11/26	470 000	103.83%	EUR	103.83%	507	488 485
FRTR 2% 05/48	100 000	137.44%	EUR	137.44%	1 869	139 312
SPGB 3.45% 07/66	55 000	157.84%	EUR	157.84%	1 431	88 242
SPGB 0.45% 10/22	900 000	101.62%	EUR	101.62%	2 025	916 605
BTPS 3.45% 03/48	115 000	117.63%	EUR	117.63%	658	135 936
RAGB 0.75% 10/26	300 000	107.32%	EUR	107.32%	1 193	323 147
IRISH 0% 10/22	60 000	101.10%	EUR	101.10%		60 660
CCTS Float 12/20	100 000	100.18%	EUR	100.18%	176	100 353
						3 252 447
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
KFW 0% 04/2024	250 000	101.59%	EUR	101.59%		253 970
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	200 000	92.65%	EUR	92.65%	17	185 311
SAPGR Float 03/21	200 000	99.63%	EUR	99.63%		199 260
VW Float 12/21	200 000	98.05%	EUR	98.05%	68	196 164
DB Float 12/2020	300 000	98.71%	EUR	98.71%	14	296 138
PBBGR Float 07/28/23	200 000	98.11%	EUR	98.11%	12	196 228
BNP Float 09/22	100 000	99.18%	EUR	99.18%	50	99 228
SOCGEN Float 04/22	100 000	99.00%	EUR	99.00%	41	99 039
ACAFP Float 04/22	100 000	99.18%	EUR	99.18%	18	99 196
RENAUL Float 03/2022	200 000	96.26%	EUR	96.26%	46	192 568
GFCFP Float 06/22	200 000	98.69%	EUR	98.69%	6	197 378
RENAULT Float 11/24	50 000	87.57%	EUR	87.57%	21	43 805
CAFP Float 06/22	100 000	98.98%	EUR	98.98%	17	98 999
ACAFP Float 01/2022	100 000	99.46%	EUR	99.46%	12	99 473
CAFP Float 09/2023	100 000	97.36%	EUR	97.36%	23	97 385
HSBC Float 09/22	100 000	98.82%	EUR	98.82%	32	98 853
LLOYDS Float 06/2024	100 000	95.80%	EUR	95.80%	42	95 839
HSBC Float 10/23	100 000	97.11%	EUR	97.11%	11	97 117
RBS Float 09/21	100 000	99.10%	EUR	99.10%	52	99 150
RBS Float 03/21	100 000	99.44%	EUR	99.44%	29	99 468
IBESM Float 02/24	200 000	98.76%	EUR	98.76%	105	197 615
AMSSM Float 03/22	200 000	97.43%	EUR	97.43%	10	194 864
SANTAN Float 03/23	200 000	97.25%	EUR	97.25%	71	194 575
ISPIM Float 04/22	100 000	97.92%	EUR	97.92%	22	97 941
FCABNK Float 06/21	100 000	97.70%	EUR	97.70%		97 700
ISPIM Float 02/2021	100 000	99.30%	EUR	99.30%	118	99 415
WFC Float 01/22	100 000	98.61%	EUR	98.61%	1	98 608
BAC Float 05/23	100 000	98.52%	EUR	98.52%	94	98 615

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2020-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
GM Float 05/21	200 000	94.74%	EUR	94.74%	126	189 602
C Float 03/23	100 000	97.98%	EUR	97.98%	12	97 992
BAC FLOAT 04/24	100 000	97.43%	EUR	97.43%	6	97 436
T Float 09/23	200 000	98.20%	EUR	98.20%	134	196 538
GS Float 04/2023	100 000	97.08%	EUR	97.08%	9	97 091
DT Float 12/2022	200 000	98.71%	EUR	98.71%		197 418
BAYNGR Float 06/22	200 000	98.34%	EUR	98.34%	35	196 707
INTNED Float 09/23	100 000	97.69%	EUR	97.69%	52	97 743
ANNGR Float 12/2022	200 000	97.65%	EUR	97.65%	12	195 314
JYBC Float 12/22	100 000	98.83%	EUR	98.83%	29	98 863
KBCBB Float 11/22	100 000	97.50%	EUR	97.50%	26	97 530
ABIBB Float 04/24	200 000	96.64%	EUR	96.64%	7	193 293
DLTAS 2008-1 A	46 676	98.50%	EUR	98.50%	1	45 977
DHR Float 06/22	200 000	98.02%	EUR	98.02%		196 036
SUMIBK Float 06/22	200 000	97.30%	EUR	97.30%		194 600
BMO Float 03/22	100 000	98.81%	EUR	98.81%	1	98 806
GS Float 07/2022	75 000	98.57%	EUR	98.57%	7	73 934
GE FLOAT 5/21	200 000	98.70%	EUR	98.70%		197 400
						6 232 211
Ações						
BMW	422	54.05	EUR	54.05		22 809
DEUTSCHE BANK	3 015	6.78	EUR	6.78		20 436
SIEMENS	560	84.68	EUR	84.68		47 421
ALLIANZ	131	168.88	EUR	168.88		22 123
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 154	9.15	EUR	9.15		10 554
BASF	496	46.69	EUR	46.69		23 156
BAYER AG	706	60.14	EUR	60.14		42 459
ADIDAS- SALOMON AG	83	209.20	EUR	209.20		17 364
SAP SE	503	108.94	EUR	108.94		54 797
DEUTSCHE TELEKOM	2 611	13.33	EUR	13.33		34 792
DAIMLER CHRYSLER	814	31.54	EUR	31.54		25 669
INFINEON TECHNOLOGIE	748	16.95	EUR	16.95		12 679
DEUTSCHE POST	1 111	27.15	EUR	27.15		30 164
FRESENIUS SE&CO KGAA	297	39.63	EUR	39.63		11 770
WIRECARD AG	66	90.40	EUR	90.40		5 966
SIEMENS HEALTHIN	338	40.20	EUR	40.20		13 588
DANONE	482	63.26	EUR	63.26		30 491
AXA-UAP	509	16.20	EUR	16.20		8 244
PERNOD RICARD	162	139.10	EUR	139.10		22 534
TOTAL SA	1 370	32.85	EUR	32.85		45 005
L OREAL	165	265.30	EUR	265.30		43 775
Kering	44	460.20	EUR	460.20		20 249
PEUGEOT CITROEN	1 000	13.08	EUR	13.08		13 075
BNP	1 020	28.68	EUR	28.68		29 249
AIR LIQUIDE	246	116.10	EUR	116.10		28 561
SCHNEIDER	158	83.46	EUR	83.46		13 187
L.V.M.H.	178	352.45	EUR	352.45		62 736
MICHELIN	94	89.10	EUR	89.10		8 375
SAINT-GOBAIN	462	24.21	EUR	24.21		11 185
BOUYGUES	310	28.11	EUR	28.11		8 714
EssilorLuxottica	155	112.65	EUR	112.65		17 461
GLE ENTREP. VINCI	331	74.70	EUR	74.70		24 726

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2020-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
DASSAULT SYSTEMES	69	133.55	EUR	133.55		9 215
SANOFI SYNHLABO	515	89.19	EUR	89.19		45 933
AIRBUS SE	388	57.88	EUR	57.88		22 457
CREDIT AGRICOLE SA	2 186	7.28	EUR	7.28		15 918
ILIAD SA	110	136.00	EUR	136.00		14 960
SAFRAN SA	96	84.22	EUR	84.22		8 085
HERMES INTERNACIONAL	16	667.80	EUR	667.80		10 685
TELEPERFORMANCE	42	204.50	EUR	204.50		8 589
RECKITT BENCKISER	164	66.30	GBP	76.38		12 526
ANGLO AMERICAN PLC	471	14.15	GBP	16.30		7 679
OCADO GROUP PLC	1 089	16.05	GBP	18.48		20 129
AMADEUS HOLDING SA	231	43.92	EUR	43.92		10 146
TELEFONICA	2 152	4.18	EUR	4.18		8 995
BCO SANTANDER C.HISP	13 955	2.04	EUR	2.04		28 433
IBERDROLA	2 465	9.14	EUR	9.14		22 530
REPSOL	877	8.31	EUR	8.31		7 291
FERROVIAL	340	22.80	EUR	22.80		7 752
INDITEX	905	23.25	EUR	23.25		21 041
TELECOM ITALIA	25 333	0.36	EUR	0.36		9 160
UNICREDITO ITALIANO	2 859	7.03	EUR	7.03		20 096
ENI SPA	728	8.71	EUR	8.71		6 344
ENEL	3 460	6.24	EUR	6.24		21 577
ESSITY AKTIEBO-B	459	317.50	SEK	29.68		13 625
ASML NA	258	270.65	EUR	270.65		69 828
AKZO NOBEL NV NLG20	221	69.20	EUR	69.20		15 293
DSM NV	150	111.75	EUR	111.75		16 763
FIAT CHRYSLER AUTOM	907	8.02	EUR	8.02		7 271
UNILEVER NV	1 321	45.58	EUR	45.58		60 211
NOKIA A	2 101	3.32	EUR	3.32		6 984
SAMPO OYJ-A SHS	941	30.24	EUR	30.24		28 456
Neste Oyj	241	32.33	EUR	32.33		7 792
KBC BANKVERZEKERING	561	49.28	EUR	49.28		27 646
ERST BK DER OEST.SPA	1 023	19.83	EUR	19.83		20 281
CRH ORD	440	27.55	EUR	27.55		12 122
						1 409 122
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					139	293 032
Obrigações diversas						
F Float 12/21	100 000	90.41%	EUR	90.41%		90 411
F Float 05/21	100 000	93.09%	EUR	93.09%	4	93 089
TACHEM Float 11/22	100 000	99.23%	EUR	99.23%	136	99 362
						282 861
Ações						
ZURICH ALLIED AG	35	307.30	CHF	290.59		10 171
						11 460 415
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						4 872 611
CXG IMOBILIARIO	182 714	4.02	EUR	4.02		734 711
CAIXA PRIVATE EQUITY	16 936	5.63	EUR	5.63		95 397
CXG INFRAESTRUTURAS	24 178	7.81	EUR	7.81		188 924
FUNDIESTAMO I	58	1 146.19	EUR	1 146.19		66 479
Fundimo	474 898	7.81	EUR	7.81		3 707 101

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2020-04-30

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		79 998
OIC DOMICILIADOS NUM ESTADO-MEMBRO DA EU						8 562 986
ALLIANZ EUOLD EQY G	522	2 542.89	EUR	2 542.89		1 327 389
SCHRODER ISF EURO EQ	58 271	38.99	EUR	38.99		2 271 934
JAN HND UK ABS RET	9 278	7.18	EUR	7.18		66 620
LYXOR EPSILON GLOB E	281	142.24	EUR	142.24		39 970
ALLIANZ RCM EUR EQTY	625	1 799.03	EUR	1 799.03		1 124 394
LFIS-VIS PR-M€A	112	933.58	EUR	933.58		104 561
EAST-US CB-CE HG	35 217	11.41	EUR	11.41		401 756
PGIS-CR BD-IN€HA	37 581	10.73	EUR	10.73		403 244
MLIS PSAM GL EV UC A	380	129.61	EUR	129.61		49 274
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	15 133	35.17	EUR	35.17		532 228
AB SCV I-EUZ EQ I	93 323	24.02	EUR	24.02		2 241 618
						13 435 598
LIQUIDEZ						
À VISTA						2 244 701
Depósitos à ordem						
DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			856
DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			138
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			1 963 487
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			124 835
DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			835
DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			37
DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			305
DO CGD - USD 0.0000%			USD			4 172
DO SANTANDER US 0.0000%			USD			150 036
						2 244 701
						2 244 701
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
VALORES ACTIVOS						145 348
VALORES PASSIVOS						-47 931
						97 417
						27 238 131
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
VGM0 EUR EUX 06/20	15	2 877.00	EUR	2 877.00		431 550
ESM0 S&P500 06/20	5	2 887.50	USD	2 640.85		660 211
						1 091 761
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO						4 491 804.94
Valor da Unidade de Participação:		€ 6.0640				