

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2020-07-31

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.						24 332
Ações						
EDP Renováveis	1 753	13.88	EUR	13.88		24 332
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					48 022	12 503 535
Títulos de Dívida Pública						
DBR 2.5% 01/2021	336 000	101.38%	EUR	101.38%	4 820	345 443
DBR 1.5% 02/2023	100 000	105.80%	EUR	105.80%	689	106 489
DBR 0.25% 02/2029	300 000	107.63%	EUR	107.63%	344	323 246
FRTR 4.25% 10/2023	890 000	115.96%	EUR	115.96%	29 041	1 061 067
FRTR 0.25% 11/26	340 000	104.70%	EUR	104.70%	581	356 547
FRTR 2% 05/48	60 000	141.64%	EUR	141.64%	224	85 205
SPGB 3.45% 07/66	55 000	171.36%	EUR	171.36%	10	94 261
SPGB 0.45% 10/22	880 000	101.90%	EUR	101.90%	2 975	899 678
BTPS 3.45% 03/48	315 000	132.58%	EUR	132.58%	4 518	422 139
RAGB 0.75% 10/26	495 000	108.04%	EUR	108.04%	2 901	537 699
IRISH 0% 10/22	60 000	101.32%	EUR	101.32%		60 791
CCTS Float 12/20	100 000	100.33%	EUR	100.33%	81	100 407
						4 392 970
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
KFW 0% 04/2024	250 000	102.13%	EUR	102.13%		255 320
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	200 000	96.91%	EUR	96.91%	5	193 821
SAPGR Float 03/21	200 000	99.96%	EUR	99.96%		199 924
VW Float 12/21	200 000	99.72%	EUR	99.72%	104	199 534
DB Float 12/2020	300 000	99.93%	EUR	99.93%	67	299 869
PBBGR Float 07/28/23	200 000	99.75%	EUR	99.75%	10	199 502
BNP Float 09/22	100 000	100.81%	EUR	100.81%	51	100 859
SOCGEN Float 04/22	100 000	100.45%	EUR	100.45%	38	100 489
ACAFP Float 04/22	100 000	100.67%	EUR	100.67%	12	100 684
RENAUL Float 03/2022	200 000	98.22%	EUR	98.22%	81	196 513
GFCFP Float 06/22	200 000	99.35%	EUR	99.35%		198 702
RENAULT Float 11/24	50 000	93.32%	EUR	93.32%	38	46 699
CAFP Float 06/22	100 000	99.96%	EUR	99.96%	34	99 989
ACAFP Float 01/2022	100 000	100.49%	EUR	100.49%	4	100 494
CAFP Float 09/2023	100 000	99.70%	EUR	99.70%	40	99 735
HSBC Float 09/22	100 000	100.14%	EUR	100.14%	29	100 168
LLOYDS Float 06/2024	100 000	99.53%	EUR	99.53%	43	99 574
HSBC Float 10/23	100 000	99.10%	EUR	99.10%	5	99 105
RBS Float 09/21	100 000	100.61%	EUR	100.61%	46	100 652
RBS Float 03/21	100 000	100.19%	EUR	100.19%	53	100 243
IBESM Float 02/24	200 000	99.17%	EUR	99.17%	160	198 508
AMSSM Float 03/22	200 000	98.05%	EUR	98.05%	19	196 111
SANTAN Float 03/23	200 000	99.75%	EUR	99.75%	64	199 560
ISPIM Float 04/22	100 000	99.95%	EUR	99.95%	17	99 963
FCABNK Float 06/21	100 000	98.83%	EUR	98.83%		98 826
ISPIM Float 02/2021	100 000	99.88%	EUR	99.88%	145	100 024
WFC Float 01/22	100 000	100.16%	EUR	100.16%	0	100 156
BAC Float 05/23	100 000	100.31%	EUR	100.31%	128	100 434

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2020-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
GM Float 05/21	200 000	98.91%	EUR	98.91%	192	198 012
C Float 03/23	100 000	99.84%	EUR	99.84%	12	99 852
BAC FLOAT 04/24	100 000	99.94%	EUR	99.94%	3	99 943
T Float 09/23	200 000	99.73%	EUR	99.73%	168	199 626
GS Float 04/2023	100 000	99.29%	EUR	99.29%	3	99 296
DT Float 12/2022	200 000	100.23%	EUR	100.23%	20	200 482
BAYNGR Float 06/22	200 000	99.74%	EUR	99.74%	30	199 500
INTNED Float 09/23	100 000	100.36%	EUR	100.36%	51	100 410
ANNGR Float 12/2022	200 000	99.40%	EUR	99.40%	14	198 806
JYBC Float 12/22	100 000	100.54%	EUR	100.54%	53	100 595
KBCBB Float 11/22	100 000	99.95%	EUR	99.95%	51	100 004
ABIBB Float 04/24	200 000	98.83%	EUR	98.83%		197 660
DLTAS 2008-1 A	43 053	99.64%	EUR	99.64%	1	42 898
DHR Float 06/22	200 000	99.54%	EUR	99.54%		199 088
SUMIBK Float 06/22	200 000	99.86%	EUR	99.86%	24	199 744
BMO Float 03/22	100 000	100.31%	EUR	100.31%	19	100 330
GS Float 07/2022	75 000	100.30%	EUR	100.30%	6	75 228
GE FLOAT 5/21	200 000	99.71%	EUR	99.71%		199 410
						6 341 022
Ações						
BMW	422	54.70	EUR	54.70		23 083
DEUTSCHE BANK	3 015	7.59	EUR	7.59		22 887
SIEMENS	560	108.32	EUR	108.32		60 659
ALLIANZ	131	176.22	EUR	176.22		23 085
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 154	9.94	EUR	9.94		11 466
BASF	496	46.81	EUR	46.81		23 218
BAYER AG	807	56.24	EUR	56.24		45 386
ADIDAS- SALOMON AG	83	233.90	EUR	233.90		19 414
SAP SE	503	133.78	EUR	133.78		67 291
DEUTSCHE TELEKOM	2 611	14.17	EUR	14.17		36 985
DAIMLER CHRYSLER	307	37.40	EUR	37.40		11 482
INFINEON TECHNOLOGIE	748	21.13	EUR	21.13		15 805
DEUTSCHE POST	1 111	34.26	EUR	34.26		38 063
FRESENIUS SE&CO KGAA	363	42.27	EUR	42.27		15 344
SIEMENS HEALTHIN	359	43.96	EUR	43.96		15 780
DANONE	482	56.54	EUR	56.54		27 252
AXA-UAP	509	16.86	EUR	16.86		8 584
PERNOD RICARD	162	146.00	EUR	146.00		23 652
TOTAL SE	1 370	31.30	EUR	31.30		42 881
L OREAL	165	283.00	EUR	283.00		46 695
Kering	44	481.75	EUR	481.75		21 197
PEUGEOT CITROEN	1 000	13.64	EUR	13.64		13 640
BNP	1 020	34.12	EUR	34.12		34 797
AIR LIQUIDE	246	139.60	EUR	139.60		34 342
SCHNEIDER	158	98.24	EUR	98.24		15 522
L.V.M.H.	164	366.75	EUR	366.75		60 147
MICHELIN	94	88.34	EUR	88.34		8 304
SAINT-GOBAIN	462	31.17	EUR	31.17		14 401
BOUYGUES	310	30.00	EUR	30.00		9 300
EssilorLuxottica	155	112.20	EUR	112.20		17 391
GLE ENTREP. VINCI	331	72.80	EUR	72.80		24 097

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2020-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
DASSAULT SYSTEMES	69	154.10	EUR	154.10		10 633
SANOFI SYNHLABO	527	88.55	EUR	88.55		46 666
AIRBUS SE	388	62.01	EUR	62.01		24 060
CREDIT AGRICOLE SA	2 186	8.13	EUR	8.13		17 763
ILIAD SA	110	166.40	EUR	166.40		18 304
SAFRAN SA	96	89.44	EUR	89.44		8 586
HERMES INTERNACIONAL	16	686.20	EUR	686.20		10 979
TELEPERFORMANCE	42	247.30	EUR	247.30		10 387
RECKITT BENCKISER	164	77.06	GBP	85.59		14 038
ANGLO AMERICAN PLC	471	18.70	GBP	20.77		9 784
OCADO GROUP PLC	615	20.53	GBP	22.80		14 024
AMADEUS HOLDING SA	231	42.36	EUR	42.36		9 785
TELEFONICA	2 152	3.55	EUR	3.55		7 635
BCO SANTANDER C.HISP	13 955	1.81	EUR	1.81		25 239
IBERDROLA	2 465	10.92	EUR	10.92		26 918
REPSOL	877	6.58	EUR	6.58		5 771
FERROVIAL	340	20.74	EUR	20.74		7 052
INDITEX	905	22.52	EUR	22.52		20 381
TELECOM ITALIA	25 333	0.34	EUR	0.34		8 633
UNICREDITO ITALIANO	2 859	7.72	EUR	7.72		22 074
ENI SPA	728	7.54	EUR	7.54		5 490
ENEL	3 460	7.73	EUR	7.73		26 742
ESSITY AKTIEBO-B	459	288.50	SEK	27.89		12 800
ASML NA	258	299.70	EUR	299.70		77 323
AKZO NOBEL NV NLG20	221	79.74	EUR	79.74		17 623
DSM NV	150	129.60	EUR	129.60		19 440
FIAT CHRYSLER AUTOM	907	8.62	EUR	8.62		7 818
UNILEVER NV	1 321	50.08	EUR	50.08		66 156
Prosus NV	283	82.10	EUR	82.10		23 234
NOKIA A	2 101	4.06	EUR	4.06		8 530
SAMPO OYJ-A SHS	941	30.67	EUR	30.67		28 860
Neste Oyj	241	38.88	EUR	38.88		9 370
KBC BANKVERZEKERING	561	48.32	EUR	48.32		27 108
ERST BK DER OEST.SPA	1 023	18.90	EUR	18.90		19 335
CRH ORD	440	30.76	EUR	30.76		13 534
						1 514 224
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					222	303 727
Obrigações diversas						
F Float 12/21	100 000	94.77%	EUR	94.77%	14	94 779
F Float 05/21	100 000	96.97%	EUR	96.97%	41	97 006
TACHEM Float 11/22	100 000	100.85%	EUR	100.85%	168	101 020
						292 804
Ações						
ZURICH ALLIED AG	35	336.20	CHF	312.06		10 922
						12 831 593
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						4 821 032
CXG IMOBILIARIO	182 714	4.02	EUR	4.02		733 999
CAIXA PRIVATE EQUITY	16 936	5.24	EUR	5.24		88 758
CXG INFRAESTRUTURAS	24 178	7.35	EUR	7.35		177 817

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2020-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
FUNDIESTAMO I	58	1 161.37	EUR	1 161.37		67 359
Fundimo	481 037	7.80	EUR	7.80		3 753 099
OIC DOMICILIADOS NUM ESTADO-MEMBRO DA EU						9 080 926
ALLIANZ EUOLD EQY G	522	2 876.80	EUR	2 876.80		1 501 690
SCHRODER ISF EURO EQ	54 437	42.24	EUR	42.24		2 299 620
JAN HND UK ABS RET	9 278	7.28	EUR	7.28		67 541
LYXOR EPSILON GLOB E	281	141.62	EUR	141.62		39 796
ALLIANZ RCM EUR EQTY	625	2 036.80	EUR	2 036.80		1 273 000
LFIS-VIS PR-M€A	112	937.75	EUR	937.75		105 028
EAST-US CB-CE HG	35 217	12.14	EUR	12.14		427 605
PGIS-CR BD-IN€HA	37 581	11.44	EUR	11.44		429 927
MLIS PSAM GL EV UC A	380	138.27	EUR	138.27		52 566
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	15 133	37.14	EUR	37.14		562 040
AB SCV I-EUZ EQ I	89 004	26.09	EUR	26.09		2 322 114
						13 901 958
LIQUIDEZ						
À VISTA						1 617 943
Depósitos à ordem						
DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			893
DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			138
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			1 226 706
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			172 989
DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			1 227
DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			38
DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			83
DO CGD - USD 0.0000%			USD			5 412
DO SANTANDER US 0.0000%			USD			210 457
						1 617 943
						1 617 943
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
VALORES ACTIVOS						195 623
VALORES PASSIVOS						-39 453
						156 171
						28 507 666
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDORRESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
VGU0 EUR EUX 09/20	15	3 145.00	EUR	3 145.00		471 750
ESU0 S&P500 09/20	4	3 225.75	USD	2 729.06		545 812
						1 017 562
						1 017 562
						1 017 562
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					4 512 661.36	
Valor da Unidade de Participação:		€ 6.3173				