

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63, 1000-300 LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2019-11-30

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.					111	37 626
Obrigações diversas						
RENEPL Float 20	20 000	100.36%	EUR	100.36%	111	20 184
Ações						
EDP Renováveis	1 753	9.95	EUR	9.95		17 442
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					21 901	14 252 215
Títulos de Dívida Pública						
DBR 1.5% 02/2023	223 000	106.98%	EUR	106.98%	2 649	241 207
DBR 1.25% 08/48	47 000	131.93%	EUR	131.93%	173	62 180
FRTR 4.25% 10/2023	360 000	118.92%	EUR	118.92%	1 547	429 659
FRTR 0.25% 11/26	800 000	103.77%	EUR	103.77%	33	830 153
SPGB 1.95% 07/2030	20 000	115.28%	EUR	115.28%	132	23 187
SPGB 3.45% 07/66	100 000	160.27%	EUR	160.27%	1 169	161 441
SPGB 0.45% 10/22	966 000	102.21%	EUR	102.21%	368	987 736
BTPS 4% 2/2037	565 000	130.05%	EUR	130.05%	7 492	742 297
BTPS 2% 12/2025	200 000	107.02%	EUR	107.02%	2 000	216 040
BTPS 3.45% 03/48	50 000	124.37%	EUR	124.37%	431	62 614
BOTS 0% 12/2019	300 000	99.65%	EUR	99.65%	1 070	300 010
T 2.515% 01/2020	125 000	97.67%	USD	97.67%	2 184	112 972
NETHER 0.75% 07/28	300 000	109.11%	EUR	109.11%	855	328 185
RAGB 0.75% 10/26	120 000	107.24%	EUR	107.24%	103	128 794
RAGB 0% 07/2023	300 000	101.91%	EUR	101.91%		305 718
IRISH 0% 10/22	200 000	101.33%	EUR	101.33%		202 650
CCTS Float 12/20	100 000	100.49%	EUR	100.49%	254	100 744
						5 235 587
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	50 000	101.16%	EUR	101.16%		50 578
KFW 0% 04/2024	250 000	101.63%	EUR	101.63%		254 083
						304 660
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	200 000	99.48%	EUR	99.48%	7	198 959
SAPGR Float 03/21	200 000	100.17%	EUR	100.17%		200 346
VW Float 12/21	200 000	100.47%	EUR	100.47%	119	201 059
CMZB Float 12/20	100 000	100.31%	EUR	100.31%	3	100 314
DB Float 12/2020	200 000	99.64%	EUR	99.64%	27	199 297
BNP Float 09/22	100 000	101.29%	EUR	101.29%	87	101 377
SOCGEN Float 04/22	100 000	101.00%	EUR	101.00%	74	101 077
ACAFP Float 04/22	100 000	101.03%	EUR	101.03%	44	101 073
RENAUL Float 03/2022	100 000	99.98%	EUR	99.98%	50	100 027
GFCFP Float 06/22	200 000	100.20%	EUR	100.20%		200 390
RENAULT Float 11/24	50 000	96.76%	EUR	96.76%	7	48 386
ALDFP Float 11/20	100 000	100.18%	EUR	100.18%	0	100 181
CAFP Float 06/22	100 000	100.26%	EUR	100.26%	39	100 303
ACAFP Float 01/2022	100 000	100.68%	EUR	100.68%	17	100 698
HSBC Float 09/22	100 000	100.52%	EUR	100.52%	52	100 570
HSBC Float 10/23	100 000	99.89%	EUR	99.89%	11	99 902
RBS Float 09/21	100 000	100.76%	EUR	100.76%	88	100 849
RBS Float 03/21	100 000	100.15%	EUR	100.15%	48	100 201

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63, 1000-300 LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2019-11-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
AMSSM Float 03/22	200 000	100.14%	EUR	100.14%	23	200 295
SCANIA Float 04/20	100 000	100.06%	EUR	100.06%		100 060
FCABNK Float 06/21	100 000	99.85%	EUR	99.85%		99 850
ISPIM Float 02/2021	100 000	100.68%	EUR	100.68%	4	100 681
WFC Float 01/22	100 000	100.31%	EUR	100.31%	8	100 321
BAC Float 05/23	100 000	100.79%	EUR	100.79%	29	100 817
GM Float 05/21	200 000	100.21%	EUR	100.21%	30	200 442
C Float 03/23	100 000	100.21%	EUR	100.21%	20	100 231
BAC FLOAT 04/24	100 000	100.49%	EUR	100.49%	31	100 518
MS Float 05/21	100 000	100.07%	EUR	100.07%		100 066
T Float 09/23	200 000	101.30%	EUR	101.30%	202	202 806
NDASS Float 09/21	100 000	100.65%	EUR	100.65%	16	100 664
MYL Float 05/20	100 000	99.96%	EUR	99.96%	2	99 965
BAYNGR Float 06/22	200 000	100.21%	EUR	100.21%	54	200 480
INTNED Float 09/23	100 000	101.34%	EUR	101.34%	91	101 430
BMW Float 01/2021	100 000	100.26%	EUR	100.26%	8	100 268
INTNED Float 04/22	100 000	100.50%	EUR	100.50%		100 499
ANNGR Float 12/2022	200 000	99.92%	EUR	99.92%	21	199 863
JYBC Float 12/22	100 000	100.69%	EUR	100.69%	43	100 737
CBSBKF Float 03/21	100 000	100.17%	EUR	100.17%	14	100 184
KBCBB Float 11/22	100 000	100.66%	EUR	100.66%	2	100 664
ABIBB Float 04/24	200 000	99.82%	EUR	99.82%		199 642
DLTAS 2008-1 A	52 705	99.82%	EUR	99.82%	1	52 611
DHR Float 06/22	200 000	99.92%	EUR	99.92%		199 836
DE FLOAT 10/22	200 000	100.01%	EUR	100.01%		200 014
SUMIBK Float 06/22	200 000	100.22%	EUR	100.22%	21	200 469
BMO Float 03/22	100 000	100.61%	EUR	100.61%	14	100 622
CAFP Float 03/2020	100 000	100.05%	EUR	100.05%	25	100 078
SANTAN Float 03/2020	100 000	100.12%	EUR	100.12%	40	100 156
UPS Float 07/2020	100 000	100.20%	EUR	100.20%	2	100 199
DE Float 04/20	100 000	100.10%	EUR	100.10%		100 102
GS Float 07/2022	75 000	101.70%	EUR	101.70%	42	76 317
GS Float 29/05/2020	85 000	100.27%	EUR	100.27%	1	85 228
SAPGR Float 04/2020	65 000	100.01%	EUR	100.01%		65 005
MMM Float 05/20	100 000	100.15%	EUR	100.15%		100 146
WFC Float 04/21	100 000	100.66%	EUR	100.66%	20	100 677
GE FLOAT 5/21	100 000	99.67%	EUR	99.67%		99 672
RABOBK Float 05/2020	150 000	100.17%	EUR	100.17%		150 257
						6 896 885
Ações						
BMW	207	73.30	EUR	73.30		15 173
SIEMENS	505	117.12	EUR	117.12		59 146
ALLIANZ	314	217.35	EUR	217.35		68 248
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 154	9.50	EUR	9.50		10 961
BASF	314	68.22	EUR	68.22		21 421
BAYER AG	706	68.70	EUR	68.70		48 502
ADIDAS- SALOMON AG	111	282.75	EUR	282.75		31 385
SAP SE	503	123.48	EUR	123.48		62 110
DEUTSCHE TELEKOM	1 171	15.24	EUR	15.24		17 841
DAIMLER CHRYSLER	531	51.20	EUR	51.20		27 187
DEUTSCHE POST	668	33.84	EUR	33.84		22 605

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63, 1000-300 LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2019-11-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
PORSCHE AG-PFD	141	67.18	EUR	67.18		9 472
VOLKSWAGEN AG-PREF.	127	175.48	EUR	175.48		22 286
CONTINENTAL AG	61	118.60	EUR	118.60		7 235
FRESENIUS SE&CO KGAA	297	49.64	EUR	49.64		14 743
WIRECARD AG	158	119.80	EUR	119.80		18 928
COVESTRO AG	352	42.50	EUR	42.50		14 960
SIEMENS HEALTHIN	338	44.02	EUR	44.02		14 879
DANONE	482	74.72	EUR	74.72		36 015
AXA-UAP	286	24.70	EUR	24.70		7 063
PERNOD RICARD	162	166.70	EUR	166.70		27 005
TOTAL SA	920	47.64	EUR	47.64		43 829
L OREAL	165	258.70	EUR	258.70		42 686
Kering	44	546.70	EUR	546.70		24 055
BNP	1 221	50.97	EUR	50.97		62 234
AIR LIQUIDE	88	123.05	EUR	123.05		10 828
SCHNEIDER	364	87.60	EUR	87.60		31 886
L.V.M.H.	164	407.30	EUR	407.30		66 797
MICHELIN	94	108.90	EUR	108.90		10 237
SAINT-GOBAIN	375	36.75	EUR	36.75		13 781
THOMSON	84	88.92	EUR	88.92		7 469
RENAULT SA	132	43.46	EUR	43.46		5 736
EssilorLuxottica	155	141.00	EUR	141.00		21 855
ORANGE	2 356	15.00	EUR	15.00		35 340
GLE ENTREP. VINCI	389	98.98	EUR	98.98		38 503
SANOFI SYNHLABO	515	84.51	EUR	84.51		43 523
AIRBUS SE	324	133.40	EUR	133.40		43 222
CREDIT AGRICOLE SA	2 594	12.42	EUR	12.42		32 205
SAFRAN SA	217	148.45	EUR	148.45		32 214
HERMES INTERNACIONAL	16	680.00	EUR	680.00		10 880
AMUNDI SA	423	68.70	EUR	68.70		29 060
RECKITT BENCKISER	164	60.66	GBP	71.23		11 681
ANGLO AMERICAN PLC	566	20.27	GBP	23.79		13 468
OCADO GROUP PLC	1 089	13.25	GBP	15.56		16 943
INFORMA PLC	1 307	7.91	GBP	9.29		12 145
TELEFONICA	1 390	6.95	EUR	6.95		9 663
BCO SANTANDER C.HISP	6 260	3.54	EUR	3.54		22 142
IBERDROLA	2 465	8.93	EUR	8.93		22 008
REPSOL	1 263	14.29	EUR	14.29		18 048
INDITEX	678	28.26	EUR	28.26		19 160
Aena SME SA	62	166.70	EUR	166.70		10 335
MASMOVIL IBERCOM	690	20.46	EUR	20.46		14 117
TELECOM ITALIA	23 272	0.57	EUR	0.57		13 223
UNICREDITO ITALIANO	2 970	12.56	EUR	12.56		37 309
BANCA INTESA	4 063	2.30	EUR	2.30		9 347
ENEL	3 460	6.86	EUR	6.86		23 722
ATLANTIA SPA	383	20.12	EUR	20.12		7 706
MEDIOLANUM SPA	2 320	9.22	EUR	9.22		21 379
INVESTOR AB	540	506.20	SEK	47.99		25 913
ESSITY AKTIEBO-B	459	301.00	SEK	28.53		13 098
ING GROEP NV	1 766	10.44	EUR	10.44		18 444
KONINKLIJKE KPN	3 981	2.80	EUR	2.80		11 131

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63, 1000-300 LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2019-11-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ASML NA	314	247.00	EUR	247.00		77 558
AKZO NOBEL NV NLG20	282	86.92	EUR	86.92		24 511
DSM NV	252	116.30	EUR	116.30		29 308
FIAT CHRYSLER AUTOM	627	13.42	EUR	13.42		8 414
EURONEXT NV	255	68.55	EUR	68.55		17 480
UNILEVER NV	1 321	53.80	EUR	53.80		71 070
NOKIA A	5 664	3.21	EUR	3.21		18 190
Neste Oyj	827	30.68	EUR	30.68		25 372
KONE OYJ-B	236	56.82	EUR	56.82		13 410
CRH ORD	440	34.73	EUR	34.73		15 281
						1 815 082
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					25	301 508
Obrigações diversas						
F Float 05/21	100 000	99.12%	EUR	99.12%	2	99 117
TACHEM Float 11/22	100 000	102.05%	EUR	102.05%	19	102 070
TACHEM Float 11/20	100 000	100.32%	EUR	100.32%	4	100 321
						301 508
						14 591 348
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						3 268 412
CXG IMOBILIARIO	182 714	4.02	EUR	4.02		733 853
CAIXA PRIVATE EQUITY	16 936	5.56	EUR	5.56		94 096
CXG INFRAESTRUTURAS	23 442	7.86	EUR	7.86		184 343
FUNDIESTAMO I	58	1 145.52	EUR	1 145.52		66 440
Fundimo	274 060	7.70	EUR	7.70		2 110 920
Fnd LImob. MAXIRENT	7 207	10.93	EUR	10.93		78 760
OIC DOMICILIADOS NUM ESTADO-MEMBRO DA EU						9 349 170
ALLIANZ EUOLD EQY G	192	2 821.67	EUR	2 821.67		541 761
JANUS HEND H. PAN AL	1 764	17.09	EUR	17.09		30 147
SCHRODER ISF EURO EQ	38 140	45.63	EUR	45.63		1 740 248
MERRILL LYNCH MARSH	469	136.62	EUR	136.62		64 075
JAN HND UK ABS RET	9 278	7.12	EUR	7.12		66 045
MERIAN GLOBAL INVEST	26 555	1.40	EUR	1.40		37 307
SCH EUROP ALPHA ABS	431	95.82	EUR	95.82		41 298
LYXOR EPSILON GLOB E	281	135.89	EUR	135.89		38 185
ALLIANZ RCM EUR EQTY	625	1 993.75	EUR	1 993.75		1 246 094
AMUNDI CASH INST SRI	4	218 225.10	EUR	218 225.10		872 900
JANUS HEND HORIZ EUR	114 226	15.20	EUR	15.20		1 736 235
LFIS-VIS PR-M€A	112	1 049.83	EUR	1 049.83		117 581
DNCA INVEST-MIURA-I	181	115.92	EUR	115.92		20 982
MLIS PSAM GL EV UC A	380	137.34	EUR	137.34		52 213
AM-EURL EQ-I2EC	173 544	10.12	EUR	10.12		1 756 265
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	10 982	38.03	EUR	38.03		417 645
XUS TREASURY €	4 802	118.74	EUR	118.74		570 189
OIC DOMICL. EM ESTADOS NÃO MEMBROS DA EU						431 652
ISHARES TREASURY B	18 187	26.16	USD	23.73		431 652
						13 049 234
LIQUIDEZ						
À VISTA						1 706 577

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63, 1000-300 LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2019-11-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
Depósitos à ordem						
DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			407
DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			139
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			1 578 035
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			76 690
DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			847
DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			41
DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			310
DO CGD - USD 0.0000%			USD			1 016
DO SANTANDER US 0.0000%			USD			49 092
						1 706 577
						1 706 577
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
VALORES ACTIVOS						118 933
VALORES PASSIVOS						-59 541
						59 393
						29 406 552
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
VGZ9 EUR EUX 12/19	28	3 695.00	EUR	3 695.00		1 034 600
ESZ9 S&P500 12/19	-7	3 144.75	USD	2 853.68		-998 786
						35 814
						35 814
						35 814
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					4 622 575.03	
Valor da Unidade de Participação: € 6.3615						