

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2019-12-31

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.					185	38 619
Obrigações diversas						
RENEPL Float 20	20 000	100.14%	EUR	100.14%	185	20 213
Ações						
EDP Renováveis	1 753	10.50	EUR	10.50		18 407
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					24 235	14 883 803
Títulos de Dívida Pública						
DBR 1.5% 02/2023	223 000	106.50%	EUR	106.50%	2 933	240 434
DBR 0.5% 08/27	295 000	106.45%	EUR	106.45%	560	314 599
DBR 1.25% 08/48	47 000	125.47%	EUR	125.47%	223	59 195
FRTR 4.25% 10/2023	360 000	118.24%	EUR	118.24%	2 843	428 521
FRTR 0.25% 11/26	1 000 000	102.77%	EUR	102.77%	253	1 027 983
SPGB 1.95% 07/2030	20 000	114.57%	EUR	114.57%	165	23 079
SPGB 3.45% 07/66	100 000	158.57%	EUR	158.57%	1 461	160 034
SPGB 0.45% 10/22	966 000	102.20%	EUR	102.20%	736	987 940
BTPS 4% 2/2037	565 000	128.66%	EUR	128.66%	9 396	736 308
BTPS 2% 12/2025	200 000	106.96%	EUR	106.96%	339	214 249
BTPS 3.45% 03/48	50 000	121.78%	EUR	121.78%	578	61 468
BOTS 0% 10/2020	300 000	100.16%	EUR	100.16%		300 474
T 2.515% 01/2020	125 000	97.61%	USD	97.61%	2 363	111 048
NETHER 0.75% 07/28	320 000	107.60%	EUR	107.60%	1 115	345 441
RAGB 0.75% 10/26	170 000	106.32%	EUR	106.32%	254	181 003
RAGB 0% 07/2023	300 000	101.66%	EUR	101.66%		304 992
IRISH 0% 10/22	200 000	101.15%	EUR	101.15%		202 300
CCTS Float 12/20	100 000	100.55%	EUR	100.55%	22	100 573
						5 799 642
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
BERGER Float 10/22	50 000	101.09%	EUR	101.09%		50 543
KFW 0% 04/2024	250 000	101.20%	EUR	101.20%		252 998
						303 540
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	200 000	99.50%	EUR	99.50%	11	199 007
SAPGR Float 03/21	200 000	100.24%	EUR	100.24%		200 474
VW Float 12/21	200 000	100.44%	EUR	100.44%	39	200 921
CMZB Float 12/20	100 000	100.29%	EUR	100.29%	4	100 293
DB Float 12/2020	200 000	99.76%	EUR	99.76%	13	199 541
BNP Float 09/22	100 000	101.29%	EUR	101.29%	11	101 303
SOCGEN Float 04/22	100 000	100.99%	EUR	100.99%	112	101 101
ACAFP Float 04/22	100 000	101.02%	EUR	101.02%	78	101 095
RENAUL Float 03/2022	100 000	100.02%	EUR	100.02%	12	100 036
GFCFP Float 06/22	200 000	100.32%	EUR	100.32%		200 630
RENAULT Float 11/24	50 000	97.02%	EUR	97.02%	14	48 522
ALDFP Float 11/20	100 000	100.18%	EUR	100.18%	3	100 178
CAFP Float 06/22	100 000	100.21%	EUR	100.21%	10	100 224
ACAFP Float 01/2022	100 000	100.67%	EUR	100.67%	28	100 701
HSBC Float 09/22	100 000	100.52%	EUR	100.52%	4	100 525
HSBC Float 10/23	100 000	99.98%	EUR	99.98%	18	99 998
RBS Float 09/21	100 000	100.77%	EUR	100.77%	7	100 780

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
 Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
 Composição da Carteira em 2019-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
RBS Float 03/21	100 000	100.18%	EUR	100.18%	17	100 201
AMSSM Float 03/22	200 000	100.18%	EUR	100.18%	4	200 362
SCANIA Float 04/20	100 000	100.04%	EUR	100.04%		100 039
FCABNK Float 06/21	100 000	99.90%	EUR	99.90%		99 902
ISPIM Float 02/2021	100 000	100.56%	EUR	100.56%	63	100 618
WFC Float 01/22	100 000	100.30%	EUR	100.30%	16	100 319
BAC Float 05/23	100 000	100.78%	EUR	100.78%	62	100 844
GM Float 05/21	200 000	100.25%	EUR	100.25%	79	200 573
C Float 03/23	100 000	100.22%	EUR	100.22%	3	100 226
BAC FLOAT 04/24	100 000	100.57%	EUR	100.57%	56	100 629
MS Float 05/21	100 000	99.99%	EUR	99.99%		99 990
T Float 09/23	200 000	101.39%	EUR	101.39%	70	202 850
NDASS Float 09/21	100 000	100.62%	EUR	100.62%	1	100 616
MYL Float 05/20	100 000	99.97%	EUR	99.97%	10	99 984
BAYNGR Float 06/22	200 000	100.21%	EUR	100.21%	4	200 414
INTNED Float 09/23	100 000	101.40%	EUR	101.40%	15	101 416
BMW Float 01/2021	100 000	100.21%	EUR	100.21%	13	100 223
INTNED Float 04/22	100 000	100.51%	EUR	100.51%		100 507
ANNGR Float 12/2022	200 000	100.07%	EUR	100.07%	3	200 135
JYBC Float 12/22	100 000	100.69%	EUR	100.69%	17	100 711
CBSBKF Float 03/21	100 000	100.16%	EUR	100.16%	7	100 164
KBCBB Float 11/22	100 000	100.70%	EUR	100.70%	15	100 714
ABIBB Float 04/24	200 000	99.74%	EUR	99.74%		199 472
DLTAS 2008-1 A	52 705	99.90%	EUR	99.90%	1	52 654
DHR Float 06/22	200 000	99.94%	EUR	99.94%		199 886
DE FLOAT 10/22	200 000	100.07%	EUR	100.07%		200 144
SUMIBK Float 06/22	200 000	100.27%	EUR	100.27%	5	200 553
BMO Float 03/22	100 000	100.52%	EUR	100.52%	5	100 521
CAFP Float 03/2020	100 000	100.05%	EUR	100.05%	3	100 049
SANTAN Float 03/2020	100 000	100.07%	EUR	100.07%	16	100 090
UPS Float 07/2020	100 000	100.17%	EUR	100.17%	3	100 175
DE Float 04/20	100 000	100.08%	EUR	100.08%		100 077
GS Float 07/2022	75 000	101.68%	EUR	101.68%	81	76 339
GS Float 29/05/2020	85 000	100.22%	EUR	100.22%	23	85 211
SAPGR Float 04/2020	65 000	100.06%	EUR	100.06%		65 042
MMM Float 05/20	100 000	100.11%	EUR	100.11%		100 111
WFC Float 04/21	100 000	100.61%	EUR	100.61%	39	100 646
GE FLOAT 5/21	200 000	99.82%	EUR	99.82%		199 642
RABOBK Float 05/2020	150 000	100.14%	EUR	100.14%		150 212
						6 997 589
Ações						
BMW	207	73.14	EUR	73.14		15 140
DEUTSCHE BANK	3 015	6.92	EUR	6.92		20 855
SIEMENS	505	116.54	EUR	116.54		58 853
ALLIANZ	131	218.40	EUR	218.40		28 610
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 154	9.52	EUR	9.52		10 991
BASF	314	67.35	EUR	67.35		21 148
BAYER AG	706	72.81	EUR	72.81		51 404
ADIDAS- SALOMON AG	111	289.80	EUR	289.80		32 168
SAP SE	503	120.32	EUR	120.32		60 521
DEUTSCHE TELEKOM	1 111	14.57	EUR	14.57		16 187

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2019-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
DAIMLER CHRYSLER	531	49.37	EUR	49.37		26 215
INFINEON TECHNOLOGIE	1 141	20.31	EUR	20.31		23 174
DEUTSCHE POST	668	34.01	EUR	34.01		22 719
PORSCHE AG-PFD	141	66.64	EUR	66.64		9 396
VOLKSWAGEN AG-PREF.	127	176.24	EUR	176.24		22 382
CONTINENTAL AG	61	115.26	EUR	115.26		7 031
TELEFONICA DEUTSCH H	4 825	2.58	EUR	2.58		12 468
FRESENIUS SE&CO KGAA	297	50.18	EUR	50.18		14 903
WIRECARD AG	158	107.50	EUR	107.50		16 985
COVESTRO AG	352	41.45	EUR	41.45		14 590
SIEMENS HEALTHIN	338	42.82	EUR	42.82		14 473
GEN DES EAUX/VIVENDI	348	25.82	EUR	25.82		8 985
DANONE	482	73.90	EUR	73.90		35 620
AXA-UAP	509	25.11	EUR	25.11		12 781
PERNOD RICARD	162	159.40	EUR	159.40		25 823
TOTAL SA	920	49.20	EUR	49.20		45 264
L OREAL	165	264.00	EUR	264.00		43 560
Kering	44	585.20	EUR	585.20		25 749
BNP	1 020	52.83	EUR	52.83		53 887
AIR LIQUIDE	88	126.20	EUR	126.20		11 106
SCHNEIDER	364	91.50	EUR	91.50		33 306
L.V.M.H.	164	414.20	EUR	414.20		67 929
MICHELIN	94	109.10	EUR	109.10		10 255
SAINT-GOBAIN	375	36.50	EUR	36.50		13 688
THOMSON	84	92.52	EUR	92.52		7 772
RENAULT SA	132	42.18	EUR	42.18		5 568
EssilorLuxottica	155	135.80	EUR	135.80		21 049
ORANGE	165	13.12	EUR	13.12		2 165
GLE ENTREP. VINCI	389	99.00	EUR	99.00		38 511
SANOFI SYNHLABO	515	89.62	EUR	89.62		46 154
AIRBUS SE	324	130.48	EUR	130.48		42 276
CREDIT AGRICOLE SA	2 186	12.93	EUR	12.93		28 254
ILIAD SA	89	115.55	EUR	115.55		10 284
SAFRAN SA	217	137.65	EUR	137.65		29 870
HERMES INTERNACIONAL	16	666.20	EUR	666.20		10 659
RECKITT BENCKISER	164	61.29	GBP	72.43		11 879
ANGLO AMERICAN PLC	566	21.73	GBP	25.68		14 535
OCADO GROUP PLC	1 089	12.79	GBP	15.11		16 460
TELEFONICA	2 152	6.23	EUR	6.23		13 401
BCO SANTANDER C.HISP	3 355	3.73	EUR	3.73		12 514
IBERDROLA	2 465	9.18	EUR	9.18		22 629
REPSOL	1 263	13.93	EUR	13.93		17 594
INDITEX	678	31.45	EUR	31.45		21 323
Aena SME SA	62	170.50	EUR	170.50		10 571
TELECOM ITALIA	25 333	0.56	EUR	0.56		14 095
UNICREDITO ITALIANO	2 859	13.02	EUR	13.02		37 224
ENEL	3 460	7.07	EUR	7.07		24 469
ATLANTIA SPA	383	20.79	EUR	20.79		7 963
ESSITY AKTIEBO-B	459	301.80	SEK	28.77		13 203
ING GROEP NV	3 975	10.69	EUR	10.69		42 485
ASML NA	294	263.70	EUR	263.70		77 528

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2019-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
AKZO NOBEL NV NLG20	282	90.64	EUR	90.64		25 560
DSM NV	252	116.10	EUR	116.10		29 257
FIAT CHRYSLER AUTOM	627	13.19	EUR	13.19		8 273
UNILEVER NV	1 321	51.23	EUR	51.23		67 675
SAMPO OYJ-A SHS	941	38.91	EUR	38.91		36 614
Neste Oyj	827	31.02	EUR	31.02		25 654
KONE OYJ-B	236	58.28	EUR	58.28		13 754
KBC BANKVERZEKERING	561	67.06	EUR	67.06		37 621
ERST BK DER OEST.SPA	1 023	33.56	EUR	33.56		34 332
CRH ORD	440	35.67	EUR	35.67		15 695
						1 783 033
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					99	314 418
Obrigações diversas						
F Float 05/21	100 000	99.22%	EUR	99.22%	4	99 228
TACHEM Float 11/22	100 000	102.00%	EUR	102.00%	79	102 080
TACHEM Float 11/20	100 000	100.31%	EUR	100.31%	16	100 321
						301 629
Ações						
ZURICH ALLIED AG	35	397.10	CHF	365.39		12 789
						15 236 840
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						3 278 121
CXG IMOBILIARIO	182 714	4.01	EUR	4.01		731 788
CAIXA PRIVATE EQUITY	16 936	5.55	EUR	5.55		94 073
CXG INFRAESTRUTURAS	23 442	8.01	EUR	8.01		187 724
FUNDIESTAMO I	58	1 109.57	EUR	1 109.57		64 355
Fundímo	277 482	7.64	EUR	7.64		2 120 934
Fnd I.Imob. MAXIRENT	7 207	11.00	EUR	11.00		79 248
OIC DOMICILIADOS NUM ESTADO-MEMBRO DA EU						9 493 132
ALLIANZ EUOLD EQY G	192	2 896.72	EUR	2 896.72		556 170
JANUS HEND H. PAN AL	1 764	17.44	EUR	17.44		30 764
SCHRODER ISF EURO EQ	38 140	46.80	EUR	46.80		1 784 983
MERRILL LYNCH MARSH	469	136.39	EUR	136.39		63 967
JAN HND UK ABS RET	9 278	7.17	EUR	7.17		66 509
MERIAN GLOBAL INVEST	26 555	1.38	EUR	1.38		36 548
SCH EUROP ALPHA ABS	431	95.00	EUR	95.00		40 947
LYXOR EPSILON GLOB E	281	133.34	EUR	133.34		37 468
ALLIANZ RCM EUR EQTY	625	2 047.33	EUR	2 047.33		1 279 581
AMUNDI CASH INST SRI	4	218 153.30	EUR	218 153.30		872 613
JANUS HEND HORIZ EUR	114 226	15.39	EUR	15.39		1 757 938
LFIS-VIS PR-M€A	112	1 044.17	EUR	1 044.17		116 947
DNCA INVEST-MIURA-I	181	116.29	EUR	116.29		21 048
MLIS PSAM GL EV UC A	380	138.53	EUR	138.53		52 665
AM-EURL EQ-I2EC	173 544	10.30	EUR	10.30		1 787 503
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	10 982	38.47	EUR	38.47		422 478
XUS TREASURY €	4 802	117.66	EUR	117.66		565 003
OIC DOMICI. EM ESTADOS NÃO MEMBROS DA EU						420 192
ISHARES TREASURY B	18 187	25.94	USD	23.10		420 192
						13 191 445

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2019-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
LIQUIDEZ						
À VISTA						1 435 507
Depósitos à ordem						
DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			416
DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			138
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			1 319 229
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			87 290
DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			853
DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			42
DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			311
DO CGD - USD 0.0000%			USD			2 097
DO SANTANDER US 0.0000%			USD			25 131
						1 435 507
						1 435 507
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
VALORES ACTIVOS						120 505
VALORES PASSIVOS						-95 865
						24 639
						29 888 432
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
VGH0 EUR EUX 03/20	28	3 729.00	EUR	3 729.00		1 044 120
ESH0 S&P500 03/20	-7	3 216.25	USD	2 865.00		-1 002 750
						41 370
						41 370
						41 370
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					4 684 448.92	
Valor da Unidade de Participação: € 6.3804						