

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2020-12-31

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.						50 570
Ações						
EDP Renováveis	2 218	22.80	EUR	22.80		50 570
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					28 395	14 602 056
Títulos de Dívida Pública						
DBR 2.5% 01/2021	336 000	100.00%	EUR	100.00%	8 331	344 338
DBR 1.5% 02/2023	260 000	104.80%	EUR	104.80%	3 420	275 890
DBR 0.25% 02/2029	10 000	107.54%	EUR	107.54%	22	10 776
BKO 0% 09/2021	336 000	100.47%	EUR	100.47%		337 589
FRTR 4.25% 10/2023	600 000	114.16%	EUR	114.16%	4 751	689 687
FRTR 0.25% 11/26	940 000	105.10%	EUR	105.10%	238	988 188
SPGB 4.7% 07/2041	100 000	179.21%	EUR	179.21%	1 996	181 206
SPGB 3.45% 07/66	55 000	181.10%	EUR	181.10%	806	100 411
SPGB 0.45% 10/22	880 000	101.89%	EUR	101.89%	673	897 305
BTPS 4% 2/2037	150 000	144.60%	EUR	144.60%	2 495	219 392
BTPS 3.45% 03/48	315 000	147.42%	EUR	147.42%	3 663	468 020
RAGB 0.75% 10/26	395 000	108.18%	EUR	108.18%	593	427 915
IRISH 0% 10/22	60 000	101.27%	EUR	101.27%		60 761
CCTS Float 07/2023	200 000	101.25%	EUR	101.25%	348	202 846
						5 204 322
Outros Fundos Públicos e Equiparados						
KFW 0% 04/2024	250 000	102.12%	EUR	102.12%		255 288
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	200 000	99.77%	EUR	99.77%		199 542
SAPGR Float 03/21	200 000	100.06%	EUR	100.06%		200 122
VW Float 12/21	200 000	100.28%	EUR	100.28%	22	200 578
PBBGR Float 07/28/23	200 000	100.30%	EUR	100.30%	141	200 731
DB Float 05/2022	300 000	100.27%	EUR	100.27%	110	300 917
BNP Float 09/22	100 000	101.19%	EUR	101.19%	9	101 196
SOCGEN Float 04/22	100 000	100.79%	EUR	100.79%	91	100 876
ACAFP Float 04/22	100 000	100.83%	EUR	100.83%	59	100 890
RENAUL Float 03/2022	200 000	100.13%	EUR	100.13%	12	200 280
GFCFP Float 06/22	200 000	100.31%	EUR	100.31%		200 622
RENAULT Float 11/24	50 000	97.64%	EUR	97.64%	4	48 824
CAFP Float 06/22	100 000	100.22%	EUR	100.22%	4	100 221
ACAFP Float 01/2022	100 000	100.50%	EUR	100.50%	9	100 505
CAFP Float 09/2023	100 000	100.41%	EUR	100.41%	5	100 413
LLOYDS Float 06/2024	100 000	100.88%	EUR	100.88%	7	100 885
HSBC Float 10/23	100 000	100.48%	EUR	100.48%	0	100 484
RBS Float 09/21	100 000	100.52%	EUR	100.52%	3	100 526
RBS Float 03/21	100 000	100.07%	EUR	100.07%	6	100 080
IBESM Float 02/24	200 000	100.73%	EUR	100.73%	33	201 501
AMSSM Float 03/22	200 000	99.64%	EUR	99.64%		199 276
SANTAN Float 03/23	200 000	100.73%	EUR	100.73%	5	201 471
ISPIM Float 04/22	100 000	100.73%	EUR	100.73%	91	100 819
BACRED Float 05/22	200 000	100.56%	EUR	100.56%	68	201 178
FCABNK Float 06/21	100 000	100.08%	EUR	100.08%		100 077
ISPIM Float 02/2021	100 000	100.10%	EUR	100.10%	52	100 150

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2020-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
WFC Float 01/22	100 000	100.38%	EUR	100.38%		100 377
BAC Float 05/23	100 000	100.62%	EUR	100.62%	42	100 666
MS Float 11/22	200 000	100.41%	EUR	100.41%	54	200 866
GM Float 05/21	200 000	100.03%	EUR	100.03%	48	200 100
C Float 03/23	200 000	100.54%	EUR	100.54%		201 076
BAC FLOAT 04/24	100 000	100.63%	EUR	100.63%	35	100 667
T Float 09/23	200 000	101.31%	EUR	101.31%	51	202 677
GS Float 04/2023	100 000	100.20%	EUR	100.20%	8	100 207
DT Float 12/2022	200 000	100.53%	EUR	100.53%		201 050
BAYNGR Float 06/22	200 000	100.29%	EUR	100.29%	0	200 588
INTNED Float 09/23	100 000	101.56%	EUR	101.56%	9	101 566
ANNGR Float 12/2022	200 000	100.32%	EUR	100.32%		200 634
JYBC Float 12/22	100 000	100.80%	EUR	100.80%	6	100 804
KBCBB Float 11/22	100 000	100.63%	EUR	100.63%	2	100 635
ABIBB Float 04/24	200 000	100.41%	EUR	100.41%		200 814
DLTAS 2008-1 A	37 013	99.78%	EUR	99.78%		36 932
DHR Float 06/22	200 000	100.19%	EUR	100.19%		200 378
SUMIBK Float 06/22	200 000	100.44%	EUR	100.44%		200 874
MUFG Float 05/2023	200 000	100.47%	EUR	100.47%	4	200 944
BMO Float 03/22	100 000	100.46%	EUR	100.46%		100 458
GS Float 07/2022	75 000	101.05%	EUR	101.05%	68	75 856
GE FLOAT 5/21	200 000	100.08%	EUR	100.08%		200 156
						6 990 492
Ações						
BMW	534	72.23	EUR	72.23		38 571
DEUTSCHE BANK	3 562	8.95	EUR	8.95		31 876
SIEMENS	708	117.52	EUR	117.52		83 204
ALLIANZ	154	200.70	EUR	200.70		30 908
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 460	9.06	EUR	9.06		13 233
BASF	627	64.72	EUR	64.72		40 579
BAYER AG	1 294	48.16	EUR	48.16		62 313
ADIDAS- SALOMON AG	105	297.90	EUR	297.90		31 280
SAP SE	636	107.22	EUR	107.22		68 192
DEUTSCHE TELEKOM	3 303	14.96	EUR	14.96		49 396
DAIMLER CHRYSLER	389	57.79	EUR	57.79		22 480
INFINEON TECHNOLOGIE	946	31.39	EUR	31.39		29 695
DEUTSCHE POST	1 405	40.50	EUR	40.50		56 903
FRESENIUS SE&CO KGAA	516	37.84	EUR	37.84		19 525
SIEMENS HEALTHIN	498	41.98	EUR	41.98		20 906
Siemens Energy AG	354	30.00	EUR	30.00		10 620
DANONE	526	53.76	EUR	53.76		28 278
AXA-UAP	644	19.51	EUR	19.51		12 566
PERNOD RICARD	244	156.80	EUR	156.80		38 259
TOTAL SE	1 733	35.30	EUR	35.30		61 175
L OREAL	244	310.80	EUR	310.80		75 835
Kering	56	594.40	EUR	594.40		33 286
PEUGEOT CITROEN	1 265	22.37	EUR	22.37		28 298
BNP	1 210	43.11	EUR	43.11		52 157
AIR LIQUIDE	311	134.25	EUR	134.25		41 752
SCHNEIDER	200	118.30	EUR	118.30		23 660
L.V.M.H.	207	510.90	EUR	510.90		105 756

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2020-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
MICHELIN	119	104.95	EUR	104.95		12 489
SAINT-GOBAIN	585	37.50	EUR	37.50		21 938
BOUYGUES	392	33.65	EUR	33.65		13 191
EssilorLuxottica	196	127.55	EUR	127.55		25 000
GLE ENTREP. VINCI	419	81.36	EUR	81.36		34 090
DASSAULT SYSTEMES	88	166.15	EUR	166.15		14 621
SANOFI SYNHLABO	727	78.70	EUR	78.70		57 215
AIRBUS SE	491	89.78	EUR	89.78		44 082
CREDIT AGRICOLE SA	2 569	10.32	EUR	10.32		26 512
ILIAD SA	140	168.10	EUR	168.10		23 534
SAFRAN SA	122	115.95	EUR	115.95		14 146
HERMES INTERNACIONAL	20	879.60	EUR	879.60		17 592
TELEPERFORMANCE	53	271.30	EUR	271.30		14 379
RECKITT BENCKISER	207	65.42	GBP	73.08		15 127
ANGLO AMERICAN PLC	596	24.25	GBP	27.08		16 142
OCADO GROUP PLC	778	22.87	GBP	25.55		19 876
AMADEUS HOLDING SA	292	59.56	EUR	59.56		17 392
TELEFONICA	2 722	3.25	EUR	3.25		8 833
BCO SANTANDER C.HISP	16 937	2.54	EUR	2.54		42 986
IBERDROLA	3 118	11.70	EUR	11.70		36 481
REPSOL	1 110	8.25	EUR	8.25		9 158
FERROVIAL	430	22.60	EUR	22.60		9 718
INDITEX	1 145	26.04	EUR	26.04		29 816
TELECOM ITALIA	32 089	0.38	EUR	0.38		12 110
UNICREDITO ITALIANO	3 359	7.65	EUR	7.65		25 690
ENI SPA	921	8.55	EUR	8.55		7 873
ENEL	4 377	8.28	EUR	8.28		36 224
ESSITY AKTIEBO-B	581	264.50	SEK	26.33		15 299
ASML NA	326	397.55	EUR	397.55		129 601
AKZO NOBEL NV NLG20	280	87.86	EUR	87.86		24 601
DSM NV	190	140.80	EUR	140.80		26 752
FIAT CHRYSLER AUTOM	1 147	14.66	EUR	14.66		16 815
Prosus NV	358	88.36	EUR	88.36		31 633
NOKIA A	2 658	3.15	EUR	3.15		8 375
SAMPO OYJ-A SHS	1 127	34.57	EUR	34.57		38 960
Neste Oyj	305	59.16	EUR	59.16		18 044
KBC BANKVERZEKERING	665	57.28	EUR	57.28		38 091
ANHEUSER-BUSCH INB	662	57.01	EUR	57.01		37 741
ERST BK DER OEST.SPA	1 210	24.94	EUR	24.94		30 177
CRH ORD	557	34.02	EUR	34.02		18 949
						2 151 954
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					131	517 283
Títulos de Dívida Pública						
KOREA 0% 09/2025	100 000	101.07%	EUR	101.07%		101 065
Obrigações diversas						
F Float 12/21	100 000	98.69%	EUR	98.69%		98 694
F Float 05/21	100 000	99.34%	EUR	99.34%		99 335
TACHEM Float 11/22	200 000	101.43%	EUR	101.43%	131	202 993
						401 022

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2020-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
Ações						
ZURICH ALLIED AG	44	373.50	CHF	345.37		15 196
						15 169 909

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						4 910 196
CXG IMOBILIARIO	182 714	4.03	EUR	4.03		736 520
CAIXA PRIVATE EQUITY	16 936	5.58	EUR	5.58		94 510
CXG INFRAESTRUTURAS	24 178	7.45	EUR	7.45		180 080
FUNDIESTAMO I	58	1 140.61	EUR	1 140.61		66 155
Fundimo	487 173	7.87	EUR	7.87		3 832 931
OIC DOMICILIADOS NUM ESTADO-MEMBRO DA EU						9 142 563
ALLIANZ EUOLD EQY G	246	3 258.88	EUR	3 258.88		801 684
SCHRODER ISF EURO EQ	53 139	46.46	EUR	46.46		2 468 875
ALLIANZ RCM EUR EQTY	625	2 310.19	EUR	2 310.19		1 443 869
EAST-US CB-CE HG	35 217	12.22	EUR	12.22		430 387
PGIS-CR BD-IN€HA	37 581	11.62	EUR	11.62		436 691
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	15 133	39.18	EUR	39.18		592 911
AB SCV I-EUZ EQ I	84 593	29.96	EUR	29.96		2 534 406
ISHARES EUR CORP.BON	3 053	142.07	EUR	142.07		433 740
						14 052 760

LIQUIDEZ

À VISTA						1 189 757
Depósitos à ordem						
DO CGD - CHF 0.0000%			CHF			881
DO CGD - DKK 0.0000%			DKK			128
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			808 398
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			96 644
DO CGD - GBP 0.0000%			GBP			1 472
DO CGD - NOK 0.0000%			NOK			29
DO CGD - SEK 0.0000%			SEK			332
DO CGD - USD 0.0000%			USD			5 220
DO SANTANDER US 0.0000%			USD			276 655
						1 189 757
						1 189 757

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

VALORES ACTIVOS						58 019
VALORES PASSIVOS						-346 375
						-288 357
						30 124 069

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES

Em mercado regulamentado						
Futuros						
VGH1 EUR EUX 03/21	9	3 550.00	EUR	3 550.00		319 500

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2020-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ESH1 S&P500 03/21	2	3 723.00	USD	3 044.15		304 415 623 915 623 915 623 915

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

4 545 356.89

Valor da Unidade de Participação: € 6.6274