

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-11-30

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.					6 268	1 203 617
Obrigações diversas						
TAGST 09-ENGY A1/25	476 260	102.26%	EUR	102.26%	358	487 389
CXGD 1% 01/2022	700 000	101.47%	EUR	101.47%	5 910	716 228
						1 203 617
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					351 093	148 153 091
Títulos de Dívida Pública						
CCTS Float 06/2022	5 000 000	100.70%	EUR	100.70%	8 614	5 043 614
Obrigações diversas						
NOSPL 1.125% 05/23	2 500 000	102.21%	EUR	102.21%	16 413	2 571 538
SAPGR Float 03/21	2 100 000	100.07%	EUR	100.07%		2 101 365
VW 1.375% 10/2023	500 000	103.64%	EUR	103.64%	866	519 061
SAPGR 0.25% 03/2022	500 000	100.65%	EUR	100.65%	911	504 151
VW 1.25% 08/2022	900 000	102.24%	EUR	102.24%	3 760	923 947
VW Float 02/2021	300 000	100.10%	EUR	100.10%	36	300 345
DB Float 12/2020	2 000 000	100.00%	EUR	100.00%	94	2 000 114
VW 0.5% 06/2022	350 000	100.87%	EUR	100.87%	786	353 842
MRKGR 0.005% 12/2023	400 000	100.50%	EUR	100.50%	19	402 015
EOANGR 0% 09/2022	1 500 000	100.53%	EUR	100.53%		1 507 920
EOANGR 0% 12/2023	650 000	100.53%	EUR	100.53%		653 432
PBBGR Float 07/28/23	2 300 000	99.94%	EUR	99.94%	849	2 299 492
PBBGR 0.625% 02/2022	700 000	100.24%	EUR	100.24%	3 371	705 044
BASGR 0.101% 06/2023	400 000	100.70%	EUR	100.70%	198	403 014
IFXGR 0.75% 06/2023	500 000	102.28%	EUR	102.28%	1 644	513 064
MCFP 1% 09/2021	1 400 000	100.75%	EUR	100.75%	2 608	1 413 038
BNP Float 09/22	1 500 000	101.25%	EUR	101.25%	1 009	1 519 759
BPCEGP Float 03/22	500 000	101.16%	EUR	101.16%	649	506 434
RENAULT Float 04/21	100 000	100.07%	EUR	100.07%	20	100 091
ACAFP Float 04/22	1 000 000	100.89%	EUR	100.89%	340	1 009 250
BNP Float 06/24	500 000	101.05%	EUR	101.05%	319	505 579
RENAUL Float 03/2022	400 000	99.95%	EUR	99.95%	158	399 974
GFCFP Float 06/22	1 000 000	100.12%	EUR	100.12%		1 001 150
RENAULT 0.75% 09/22	2 500 000	100.97%	EUR	100.97%	3 390	2 527 540
ACAFP Float 03/23	500 000	100.68%	EUR	100.68%	142	503 552
CAFP Float 06/22	2 000 000	100.24%	EUR	100.24%	582	2 005 382
HSBC 0.2% 09/21	2 000 000	100.49%	EUR	100.49%	964	2 010 704
ACAFP Float 01/2022	1 200 000	100.54%	EUR	100.54%	62	1 206 566
BFCM 0.125% 08/2021	1 500 000	100.42%	EUR	100.42%	478	1 506 778
MCFP 0% 02/2021	300 000	100.08%	EUR	100.08%		300 228
SOCGEN 0% 05/2022	500 000	100.46%	EUR	100.46%		502 310
VIVFP 0% 06/2022	1 400 000	100.36%	EUR	100.36%		1 405 082
BPCEGP Float 01/2023	500 000	100.25%	EUR	100.25%		501 270
CAFP Float 09/2023	400 000	100.39%	EUR	100.39%	140	401 708
DSYFP 0% 09/2022	700 000	100.45%	EUR	100.45%		703 178
RENAUL 0.25% 03/23	200 000	99.79%	EUR	99.79%	367	199 937
EFFP 0% 05/23	700 000	100.48%	EUR	100.48%		703 339
CAPFP 0.625% 06/2025	2 000 000	102.94%	EUR	102.94%	5 514	2 064 274
ALDFP 0.375% 10/2023	500 000	100.63%	EUR	100.63%	221	503 361

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-11-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
F 1.875% 06/2021	1 000 000	100.02%	EUR	100.02%	8 219	1 008 409
HSBC Float 09/22	130 000	100.45%	EUR	100.45%	49	130 632
CCE FLOAT 11/21	500 000	100.17%	EUR	100.17%		500 860
RBS Float 09/21	1 400 000	100.59%	EUR	100.59%	1 013	1 409 217
DGELN 0.25% 10/2021	1 550 000	100.43%	EUR	100.43%	425	1 557 121
RBS Float 06/2021	350 000	100.30%	EUR	100.30%	168	351 225
GSK Float 09/2021	500 000	100.30%	EUR	100.30%	88	501 598
RBS Float 03/21	400 000	100.11%	EUR	100.11%	124	400 556
LLOYDS 0.375% 01/25	350 000	101.40%	EUR	101.40%	1 105	356 005
GSK 0.125% 05/2023	200 000	100.86%	EUR	100.86%	139	201 855
BACR 1.5% 09/2023	1 300 000	104.38%	EUR	104.38%	4 755	1 361 695
MRLSM 2.225% 04/23	2 000 000	104.10%	EUR	104.10%	26 822	2 108 902
SANSCF1% 05/21	1 400 000	100.68%	EUR	100.68%	7 249	1 416 783
SANTAN Float 03/22	800 000	101.02%	EUR	101.02%	819	808 971
CRUNAV Float 06/2022	500 000	99.69%	EUR	99.69%	147	498 592
CABKSM 1.125% 1/2023	2 700 000	102.45%	EUR	102.45%	26 889	2 792 958
SABSM 0.875% 03/2023	1 300 000	101.61%	EUR	101.61%	8 446	1 329 415
AMSSM Float 03/22	600 000	99.44%	EUR	99.44%		596 652
KUTXAB 0.5% 09/2024	200 000	101.83%	EUR	101.83%	184	203 840
SABSM 1.75% 06/2023	200 000	102.49%	EUR	102.49%	1 486	206 458
SWEDA 0.25% 11/22	3 000 000	100.94%	EUR	100.94%	493	3 028 753
VLVY 0.1% 05/2022	300 000	100.27%	EUR	100.27%	157	300 970
SWEDA 0.25% 10/2024	300 000	100.89%	EUR	100.89%	109	302 770
VLVY 0% 02/2023	400 000	100.22%	EUR	100.22%		400 888
VLVY 0,125% 09/2024	300 000	100.50%	EUR	100.50%	77	301 574
ISPIM 2% 06/2021	1 000 000	101.25%	EUR	101.25%	9 096	1 021 636
ISPIM Float 04/22	2 350 000	100.79%	EUR	100.79%	1 243	2 369 855
FCABNK Float 06/21	2 500 000	100.07%	EUR	100.07%		2 501 650
ACEIM Float 06223	200 000	99.99%	EUR	99.99%		199 974
FCABNK 0.625% 11/22	150 000	101.16%	EUR	101.16%	18	151 764
AZMIM 1.625% 12/2024	1 000 000	100.08%	EUR	100.08%	15 762	1 016 522
FCABNK 0.25% 02/2023	400 000	100.31%	EUR	100.31%	841	402 065
PG 2% 11/21	1 000 000	102.17%	EUR	102.17%	1 425	1 023 075
C Float 05/21	3 000 000	100.38%	EUR	100.38%	176	3 011 426
MS Float 01/22	2 500 000	100.09%	EUR	100.09%	457	2 502 582
WFC Float 01/22	1 000 000	100.40%	EUR	100.40%		1 004 000
BAC Float 02/22	1 200 000	100.11%	EUR	100.11%	208	1 201 480
GS Float 09/22	1 500 000	100.30%	EUR	100.30%	495	1 504 920
BAC Float 05/23	1 000 000	100.67%	EUR	100.67%	195	1 006 865
GM Float 05/21	1 800 000	100.01%	EUR	100.01%	175	1 800 319
GE 0.375% 05/22	3 500 000	100.49%	EUR	100.49%	7 120	3 524 130
C Float 03/23	1 000 000	100.51%	EUR	100.51%		1 005 060
MS Float 05/21	500 000	100.21%	EUR	100.21%		501 055
T Float 09/23	1 500 000	101.21%	EUR	101.21%	1 364	1 519 469
EMR 0.375% 05/2024	400 000	101.81%	EUR	101.81%	793	408 033
HOG 0.9% 11/19/24	250 000	100.80%	EUR	100.80%	74	252 081
FIS 0.125% 12/2022	700 000	100.62%	EUR	100.62%	870	705 175
FIS Float 05/2021	1 500 000	100.04%	EUR	100.04%		1 500 555
CB 0.3% 12/2024	800 000	101.11%	EUR	101.11%	2 367	811 255
GS Float 04/2023	1 000 000	100.23%	EUR	100.23%	47	1 002 387
F 1.744% 07/2024	800 000	98.96%	EUR	98.96%	5 160	796 864
HON 0% 03/2024	300 000	100.52%	EUR	100.52%		301 548

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-11-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BRK 0% 03/2025	500 000	100.55%	EUR	100.55%		502 725
UBS Float 04/2021	900 000	100.15%	EUR	100.15%		901 314
SCANIA Float 03/21	1 100 000	100.04%	EUR	100.04%		1 100 462
EDPPL 2.375% 03/23	2 000 000	105.92%	EUR	105.92%	32 925	2 151 385
DAIGR Float 05/22	1 500 000	100.12%	EUR	100.12%		1 501 860
NIBCAP 1.5% 01/22	1 000 000	101.80%	EUR	101.80%	12 500	1 030 500
DAIGR Float 01/23	500 000	99.99%	EUR	99.99%		499 955
LPTY Float 01/21	200 000	100.00%	EUR	100.00%		199 992
ADNA Float 03/21	200 000	100.02%	EUR	100.02%		200 048
BAYNGR Float 06/22	300 000	100.21%	EUR	100.21%	30	300 657
INTNED Float 09/23	1 000 000	101.57%	EUR	101.57%	688	1 016 368
TOYOTA 0.25% 01/2022	2 100 000	100.58%	EUR	100.58%	4 676	2 116 877
BMW 0.625% 10/2023	1 000 000	102.27%	EUR	102.27%	959	1 023 649
ANNGR Float 12/2022	2 000 000	100.21%	EUR	100.21%		2 004 160
NIBCAP 0.875% 07/25	400 000	101.41%	EUR	101.41%	1 400	407 056
ENELIM 0% 06/2024	700 000	100.42%	EUR	100.42%		702 933
ALVGR 0% 01/2025	1 300 000	101.26%	EUR	101.26%		1 316 432
DLR 0.125% 10/2022	300 000	100.50%	EUR	100.50%	48	301 560
REPSM 0.125% 10/2024	1 000 000	100.56%	EUR	100.56%	195	1 005 785
DANBNK 0.5% 05/21	1 000 000	100.39%	EUR	100.39%	2 863	1 006 763
NYKRE Float 06/22	2 000 000	100.42%	EUR	100.42%	465	2 008 785
DANBNK 1,375% 05/23	2 000 000	101.83%	EUR	101.83%	13 174	2 049 694
JYBC 0.375% 10/2025	1 250 000	100.02%	EUR	100.02%	604	1 250 816
MINGNO 0.75% 03/23	1 500 000	102.39%	EUR	102.39%	4 654	1 540 459
SPOLNO Float 09/21	1 900 000	100.32%	EUR	100.32%	91	1 906 171
SCBNOR 0.875% 01/22	200 000	101.22%	EUR	101.22%	1 506	203 936
CBSBKF Float 03/21	600 000	100.08%	EUR	100.08%	24	600 504
KBCBB 0.75% 10/23	1 500 000	102.60%	EUR	102.60%	1 356	1 540 356
KBCBB Float 11/22	500 000	100.68%	EUR	100.68%	2	503 382
KBCBB 1.125% 01/2024	400 000	103.69%	EUR	103.69%	3 824	418 592
CCBGGB 0.01% 10/2025	600 000	100.21%	EUR	100.21%	8	601 280
RBI AV 0.25% 01/2025	2 100 000	101.09%	EUR	101.09%	4 504	2 127 415
DLTAS 2008-1 A	519 236	99.71%	EUR	99.71%		517 731
GLENLN 1.625% 01/22	1 500 000	101.42%	EUR	101.42%	21 178	1 542 493
GLENLN 1.25% 03/2021	500 000	100.05%	EUR	100.05%	4 435	504 670
DHR Float 06/22	1 000 000	100.14%	EUR	100.14%		1 001 360
BDX 0.174% 06/2021	1 000 000	100.09%	EUR	100.09%	858	1 001 798
NESNVX 0% 12/2025	800 000	101.47%	EUR	101.47%		811 792
SUMIBK Float 06/22	1 500 000	100.45%	EUR	100.45%		1 506 675
MUFG 0.98% 10/2023	1 000 000	103.16%	EUR	103.16%	1 423	1 033 033
MUFG 0.339% 07/2024	200 000	101.24%	EUR	101.24%	251	202 733
MIZUHO 0.214% 10/25	200 000	101.05%	EUR	101.05%	64	202 168
BNS FLOAT 10/22	1 000 000	100.79%	EUR	100.79%	162	1 008 092
CEZCP 4.875% 04/2025	900 000	120.52%	EUR	120.52%	27 527	1 112 162
ISLBAN 1.125% 04/22	1 400 000	101.42%	EUR	101.42%	10 054	1 429 892
ETISLT 1.75% 06/2021	900 000	101.00%	EUR	101.00%	7 163	916 172
BACR Float 03/2021	900 000	99.24%	EUR	99.24%		893 174
WFC Float 04/21	1 000 000	100.23%	EUR	100.23%	109	1 002 389
						143 109 477
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					27 656	14 223 654
Obrigações diversas						

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-11-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
HUWY 1.375% 10/2021	2 000 000	101.30%	EUR	101.30%	2 336	2 028 336
K 1.75% 05/2021	1 000 000	100.96%	EUR	100.96%	9 158	1 018 758
AMGN 1.25% 02/22	900 000	101.42%	EUR	101.42%	8 607	921 414
F Float 12/21	819 000	98.59%	EUR	98.59%		807 485
F Float 05/21	300 000	99.47%	EUR	99.47%		298 422
FDX 0.7% 05/2022	500 000	101.22%	EUR	101.22%	1 937	508 032
KO Float 03/2021	400 000	100.07%	EUR	100.07%		400 284
UBS Float 09/22	1 000 000	100.44%	EUR	100.44%	392	1 004 832
ABT 0.875% 09/2023	1 500 000	103.10%	EUR	103.10%	2 337	1 548 852
MDT Float 03/2021	2 150 000	100.07%	EUR	100.07%		2 151 591
MDT 0% 03/2023	1 500 000	100.45%	EUR	100.45%		1 506 795
TACHEM Float 11/22	500 000	101.36%	EUR	101.36%	64	506 859
WESAU 1.25% 10/2021	1 500 000	101.28%	EUR	101.28%	2 825	1 521 995
						14 223 654
						163 580 362
OUTROS VALORES						
VAL. MOBILIÁRIOS NACIONAIS NÃO COTADOS					41	32 343
Obrigações diversas						
VERSE 4 SNR 02/2021	32 222	100.25%	EUR	100.25%	41	32 343
OUTROS INSTRUMENTOS DE DÍVIDA					18 483	12 812 670
Papel Comercial						
PC ECP ANA 11/09 181D 0.1000% 2020-09-11 a 2021-03-11			EUR		247	1 099 695
PC ECP JMS 16NOV 63D 0.5000% 2020-11-16 a 2021-01-18			EUR		41	199 869
PC ECP CIE 13NOV 94D 0.4000% 2020-11-13 a 2021-02-15			EUR		320	1 598 650
PC ECP JMS 14/09 126D 1.1000% 2020-09-14 a 2021-01-18			EUR		468	199 712
PC P.C.UNILEVER 6ªEM. 0.0000% 2020-11-06 a 2020-12-09			EUR			1 000 000
PC P.C. GLINTT 19ªEM. 2.8000% 2020-10-08 a 2021-01-11			EUR		2 940	702 940
PC ECP JMS 14/10 187D 1.2000% 2020-10-14 a 2021-04-19			EUR		157	99 546
PC ECP JMS 14/10 63D 0.7500% 2020-10-14 a 2020-12-16			EUR		493	499 846
PC ECP JMS 16NOV 120D 0.7000% 2020-11-16 a 2021-03-16			EUR		57	199 598
PC P.C.UNILEVER 79ª EM. 0.0000% 2020-11-30 a 2020-12-30			EUR			700 000
PC P.C.GLINTT 20ª EM. 2.8000% 2020-10-13 a 2021-02-10			EUR		4 192	1 104 192
PC ECP JMS 14/10 96D 0.9000% 2020-10-14 a 2021-01-18			EUR		472	399 528
PC P.C.SONAE 997ª EM. 0.0300% 2020-11-27 a 2020-12-07			EUR		7	2 200 007
PC PC EDA 263 23/11 60 0.0000% 2020-11-23 a 2021-01-22			EUR			700 000
PC P.C.VISABEIRA 35ªEM 3.0000% 2020-09-30 a 2021-01-08			EUR		5 683	1 105 683
PC P.C.VISABEIRA 37ªEM 2.8500% 2020-10-19 a 2021-02-12			EUR		3 404	1 003 404
						12 812 670
						12 845 014
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						9 447 211
Fundimo	1 189 915	7.94	EUR	7.94		9 447 211
LIQUIDEZ						
À VISTA						17 162 028
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			15 966 374
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			199 851
DO SANTANDER - 0.0000%			EUR			964 886
DO BCP - EUR 0.0000%			EUR			30 917
						17 162 028

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-11-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
						17 162 028
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
VALORES ACTIVOS						104 185
VALORES PASSIVOS						-927 224
						-823 040
						202 211 576
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
OEZ0 EUR EUX 12/20	-84	135.39	EUR	135.39		-11 372 760
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					34 214 957.88	
Valor da Unidade de Participação:		€ 5.9100				