

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
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.					10 880	1 866 982
Obrigações diversas						
TAGST 09-ENGY A1/25	574 930	100.89%	EUR	100.89%	480	580 538
CXGD 1% 01/2022	1 100 000	102.32%	EUR	102.32%	10 216	1 135 681
VERSE 4 SNR 02/2021	148 713	101.25%	EUR	101.25%	184	150 762
						1 866 982
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					338 744	127 843 095
Títulos de Dívida Pública						
SPGB 0.05% 10/2021	5 500 000	100.81%	EUR	100.81%	466	5 544 741
CCTS Float 06/2022	5 000 000	100.54%	EUR	100.54%	496	5 027 496
						10 572 237
Obrigações diversas						
NOSPL 1.125% 05/23	2 500 000	102.19%	EUR	102.19%	18 750	2 573 525
SAPGR Float 03/21	1 100 000	100.24%	EUR	100.24%		1 102 607
VW 1.375% 10/2023	500 000	103.16%	EUR	103.16%	1 446	517 256
SAPGR 0.25% 03/2022	500 000	100.82%	EUR	100.82%	1 014	505 119
VW 1.25% 08/2022	900 000	102.62%	EUR	102.62%	4 703	928 310
VW Float 02/2021	300 000	100.45%	EUR	100.45%	156	301 515
DB Float 12/2020	2 000 000	99.76%	EUR	99.76%	134	1 995 414
VW 0.5% 06/2022	350 000	100.63%	EUR	100.63%	937	353 156
MRKGR 0.005% 12/2023	400 000	99.55%	EUR	99.55%	1	398 213
EOANGR 0% 09/2022	1 500 000	99.83%	EUR	99.83%		1 497 420
MCFP 1% 09/2021	1 400 000	101.80%	EUR	101.80%	3 787	1 428 959
RENAULT Float 08/20	100 000	100.03%	EUR	100.03%	6	100 038
BNP Float 09/22	1 500 000	101.29%	EUR	101.29%	170	1 519 550
BPCEGP Float 03/22	500 000	101.55%	EUR	101.55%	209	507 949
RENAULT Float 04/21	100 000	100.26%	EUR	100.26%	51	100 307
ACAFP Float 04/22	1 000 000	101.02%	EUR	101.02%	780	1 010 950
MCFP 0% 05/20	4 300 000	100.09%	EUR	100.09%		4 303 999
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.02%	EUR	100.02%	49	400 145
GFCFP Float 06/22	800 000	100.32%	EUR	100.32%		802 520
ALDFP Float 11/20	500 000	100.18%	EUR	100.18%	13	500 888
HSBC 0.2% 09/21	2 000 000	100.45%	EUR	100.45%	1 301	2 010 381
ACAFP Float 01/2022	1 200 000	100.67%	EUR	100.67%	334	1 208 410
BFCM 0.125% 08/2021	1 500 000	100.35%	EUR	100.35%	635	1 505 825
MCFP 0% 02/2021	300 000	100.24%	EUR	100.24%		300 723
SOCGEN 0% 05/2022	500 000	99.97%	EUR	99.97%		499 850
VIVFP 0% 06/2022	1 400 000	99.90%	EUR	99.90%		1 398 558
CAFP Float 09/2023	400 000	100.03%	EUR	100.03%	57	400 181
DSYFP 0% 09/2022	700 000	100.13%	EUR	100.13%		700 903
RENAUL 0.25% 03/23	200 000	99.11%	EUR	99.11%	134	198 358
EFFP 0% 05/23	700 000	100.10%	EUR	100.10%		700 714
HSBC Float 09/22	250 000	100.52%	EUR	100.52%	10	251 313
F Float 08/20	300 000	99.81%	EUR	99.81%	29	299 453
WPPLN Float 05/20	800 000	99.95%	EUR	99.95%		799 608
RBS Float 06/20	900 000	100.06%	EUR	100.06%	20	900 560
CCE FLOAT 11/21	500 000	100.33%	EUR	100.33%		501 645
RBS Float 09/21	1 400 000	100.77%	EUR	100.77%	97	1 410 919

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
DGELN 0.25% 10/2021	1 550 000	100.68%	EUR	100.68%	752	1 561 261
RBS Float 06/2021	350 000	100.29%	EUR	100.29%	44	351 042
AALLN 2.875% 11/2020	175 000	102.37%	EUR	102.37%	577	179 732
GSK Float 09/2021	500 000	100.69%	EUR	100.69%	25	503 450
RBS Float 03/21	400 000	100.18%	EUR	100.18%	68	400 804
MRLSM 2.225% 04/23	2 000 000	105.76%	EUR	105.76%	30 518	2 145 758
SANSCF1% 05/21	1 400 000	101.63%	EUR	101.63%	8 415	1 431 263
SANTAN Float 03/22	600 000	101.02%	EUR	101.02%	93	606 183
CRUNAV Float 06/2022	500 000	99.73%	EUR	99.73%	32	498 679
AMSSM Float 03/22	600 000	100.18%	EUR	100.18%	13	601 087
KUTXAB 0.5% 09/2024	200 000	99.88%	EUR	99.88%	268	200 032
SCANIA Float 04/20	500 000	100.04%	EUR	100.04%		500 195
VLVY 0.1% 05/2022	300 000	100.03%	EUR	100.03%	182	300 278
SWEDA 0.25% 10/2024	300 000	98.58%	EUR	98.58%	172	295 900
ENIIM 4.25% 02/20	700 000	100.34%	EUR	100.34%	27 060	729 454
ISPIM 4.125% 04/2020	750 000	101.25%	EUR	101.25%	22 147	781 522
ISPIM 2% 06/2021	1 000 000	102.82%	EUR	102.82%	10 765	1 038 965
ISPIM Float 04/22	2 350 000	100.77%	EUR	100.77%	2 538	2 370 704
FCABNK Float 06/21	2 500 000	99.90%	EUR	99.90%		2 497 550
FCABNK 0.625% 11/22	150 000	101.00%	EUR	101.00%	97	151 602
AZMIM 1.625% 12/2024	1 000 000	99.64%	EUR	99.64%	888	997 318
C Float 05/21	3 000 000	100.94%	EUR	100.94%	1 301	3 029 471
MS Float 01/22	2 500 000	100.39%	EUR	100.39%	1 336	2 510 961
WFC Float 01/22	1 000 000	100.30%	EUR	100.30%	164	1 003 194
BAC Float 02/22	200 000	100.42%	EUR	100.42%	121	200 955
GS Float 09/22	1 500 000	100.33%	EUR	100.33%	225	1 505 100
BAC Float 05/23	1 000 000	100.78%	EUR	100.78%	622	1 008 442
GM Float 05/21	1 800 000	100.25%	EUR	100.25%	713	1 805 159
BATSLN Float 08/21	500 000	100.07%	EUR	100.07%	62	500 417
BAC Float 09/21	2 500 000	100.13%	EUR	100.13%		2 503 300
MS Float 05/21	500 000	99.99%	EUR	99.99%		499 950
T Float 09/23	500 000	101.39%	EUR	101.39%	175	507 125
EMR 0.375% 05/2024	400 000	100.81%	EUR	100.81%	918	404 174
HOG 0.9% 11/19/24	250 000	101.29%	EUR	101.29%	264	253 479
FIS 0.125% 12/2022	700 000	100.14%	EUR	100.14%	69	701 014
CB 0.3% 12/2024	800 000	99.83%	EUR	99.83%	170	798 802
UBS Float 04/2021	900 000	100.47%	EUR	100.47%	161	904 409
SCANIA Float 03/21	1 100 000	100.10%	EUR	100.10%	23	1 101 090
ENELIM 4.875% 03/20	1 250 000	100.85%	EUR	100.85%	49 283	1 309 883
REPSM 2.625% 05/2020	2 500 000	101.15%	EUR	101.15%	39 088	2 567 738
RENEPL 4.75% 10/2020	1 600 000	103.82%	EUR	103.82%	15 989	1 677 061
ACHMEA 2.5% 11/2020	2 800 000	102.37%	EUR	102.37%	8 224	2 874 612
NOMURA 1.125% 06/20	1 000 000	100.56%	EUR	100.56%	6 516	1 012 076
BMW 0.125% 07/20	3 000 000	100.21%	EUR	100.21%	1 865	3 008 045
LPTY Float 11/20	800 000	100.23%	EUR	100.23%	162	801 994
MYL Float 05/20	800 000	99.97%	EUR	99.97%	78	799 870
LPTY Float 01/21	200 000	100.19%	EUR	100.19%	37	200 413
ADNA Float 03/21	200 000	100.00%	EUR	100.00%		200 002
DAIGR Float 04/20	300 000	100.08%	EUR	100.08%	54	300 300
TOYOTA FLT 04/27	500 000	100.06%	EUR	100.06%		500 295
BAYNGR Float 06/22	300 000	100.21%	EUR	100.21%	6	300 621
NIBCAP Float 07/20	900 000	100.03%	EUR	100.03%	143	900 401

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
TOYOTA 0.25% 01/2022	2 100 000	100.83%	EUR	100.83%	5 135	2 122 565
ANNGR Float 12/2022	2 000 000	100.07%	EUR	100.07%	26	2 001 346
NIBCAP 0.875% 07/25	400 000	100.62%	EUR	100.62%	1 693	404 181
ENELIM 0% 06/2024	700 000	98.86%	EUR	98.86%		692 013
DANBNK 0.5% 05/21	1 000 000	100.79%	EUR	100.79%	3 279	1 011 139
NYKRE Float 06/22	1 000 000	99.95%	EUR	99.95%	144	999 654
JYBC Float 06/20	1 000 000	100.09%	EUR	100.09%		1 000 850
DANBNK 1.375% 05/22	2 000 000	102.54%	EUR	102.54%	16 680	2 067 440
MINGNO 0.75% 03/23	1 500 000	102.10%	EUR	102.10%	5 594	1 537 034
SPOLNO Float 09/21	1 900 000	100.14%	EUR	100.14%	32	1 902 692
SCBNOR 0.875% 01/22	200 000	101.74%	EUR	101.74%	1 654	205 132
CBSBKF Float 03/21	600 000	100.16%	EUR	100.16%	40	600 985
KBCBB 0.75% 10/23	1 500 000	101.96%	EUR	101.96%	2 305	1 531 660
KBCBB Float 11/22	500 000	100.70%	EUR	100.70%	73	503 568
KBCBB 1.125% 01/2024	400 000	103.51%	EUR	103.51%	4 204	418 228
GE 2.25% 07/2020	2 000 000	101.18%	EUR	101.18%	20 287	2 043 947
DLTAS 2008-1 A	715 997	99.90%	EUR	99.90%	17	715 298
DHR Float 06/22	1 000 000	99.94%	EUR	99.94%		999 430
DE Float 09/20	1 000 000	100.16%	EUR	100.16%		1 001 630
BDX 0.174% 06/2021	1 000 000	100.26%	EUR	100.26%	1 003	1 003 623
SUMIBK Float 06/22	1 500 000	100.27%	EUR	100.27%	37	1 504 147
MUFG 0.98% 10/2023	1 000 000	102.64%	EUR	102.64%	2 249	1 028 669
MUFG 0.339% 07/2024	200 000	99.79%	EUR	99.79%	308	199 894
BNS FLOAT 10/22	1 000 000	100.85%	EUR	100.85%	418	1 008 868
BCHINA Float 11/20	300 000	99.98%	EUR	99.98%	21	299 970
ISLBAN 1.125% 04/22	600 000	101.87%	EUR	101.87%	4 869	616 083
BACR Float 03/2021	900 000	97.25%	EUR	97.25%	16	875 230
WFC Float 04/21	1 000 000	100.61%	EUR	100.61%	390	1 006 460
ISPIM Float 06/20	200 000	100.35%	EUR	100.35%	58	200 748
						117 270 859
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					32 204	12 638 912
Obrigações diversas						
HUWY 1.375% 10/2021	2 000 000	102.28%	EUR	102.28%	4 658	2 050 178
K 1.75% 05/2021	1 000 000	102.71%	EUR	102.71%	10 615	1 037 735
AMGN 1.25% 02/22	900 000	102.38%	EUR	102.38%	9 555	930 930
F Float 12/21	819 000	98.02%	EUR	98.02%		802 751
F Float 05/21	300 000	99.22%	EUR	99.22%	13	297 685
FDX 0.7% 05/2022	500 000	101.48%	EUR	101.48%	2 228	509 613
KO Float 03/2021	400 000	100.28%	EUR	100.28%		401 124
UBS Float 09/22	1 000 000	100.55%	EUR	100.55%	99	1 005 589
MDT Cupão Zero 03/21	1 400 000	100.24%	EUR	100.24%		1 403 388
MDT Float 03/2021	1 150 000	100.28%	EUR	100.28%		1 153 243
TACHEM 0.375% 11/20	1 500 000	100.47%	EUR	100.47%	630	1 507 710
WESAU 1.25% 10/2021	1 500 000	102.30%	EUR	102.30%	4 406	1 538 966
						12 638 912
						142 348 989
OUTROS VALORES						
OUTROS INSTRUMENTOS DE DÍVIDA					21 428	15 916 163
Papel Comercial						
PC P.C.C.AMORIM 37ºEM. 0.0500% 2019-12-18 a 2020-01-20			EUR		31	1 600 031

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
PC ECP 23DEZEMBRO-SABA 0.3300% 2019-12-23 a 2020-09-08			EUR		107	1 297 016
PC P.C.VISABEIRA 19ªEM 2.6000% 2020-01-06 a 2020-04-06			EUR			950 000
PC P.C.GLINTT 2ª EM. 2.5000% 2019-11-18 a 2020-01-17			EUR		2 750	902 750
PC P.C.VISABEIRA 18ªEM 2.6000% 2020-01-02 a 2020-06-30			EUR			950 000
PC ECP JMS 14/11 120D 0.7500% 2019-11-14 a 2020-03-13			EUR		689	698 967
PC P.C.C.BAVIERA 31ªEM. 2.7000% 2019-12-11 a 2020-01-14			EUR		945	600 945
PC P.C.S.CAETANO 18ªEM. 2.7000% 2019-11-06 a 2020-02-07			EUR		630	150 630
PC ECP ECI 7OUT 98D 0.0940% 2019-10-08 a 2020-01-14			EUR		109	499 983
PC P.C.SOGRAPÉ 8ªEM. 0.0700% 2019-11-22 a 2020-01-24			EUR		194	2 500 194
PC P.C.EEM 19ª EM. 0.4000% 2019-10-18 a 2020-01-16			EUR		750	900 750
PC ECP ECI 21-01-2020 0.0450% 2019-10-29 a 2020-01-21			EUR		39	499 988
PC P.C.VISABEIRA 12ªEM 2.6000% 2019-09-04 a 2020-01-02			EUR		7 305	857 305
PC ECP ECI 1OUT 105D 0.1190% 2019-10-01 a 2020-01-14			EUR		240	799 966
PC P.C.GRUPADO 2ª EM 2.7000% 2019-10-17 a 2020-01-13			EUR		1 995	351 995
PC P.C.C.AMORIM 36ª EM. 0.0500% 2019-12-06 a 2020-01-08			EUR		52	1 450 052
PC P.C.VISABEIRA 14ª 2.6000% 2019-10-07 a 2020-01-06			EUR		5 590	905 590
						15 916 163
						15 916 163

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL

CAIXA DISPONÍVEL	4 224 285	5.32	EUR	5.32		31 447 593
Fundimo	1 174 729	7.64	EUR	7.64		22 468 552
						8 979 041
						31 447 593

LIQUIDEZ

À VISTA

Depósitos à ordem

DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			6 769 991
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			387 301
DO SANTANDER - 0.0000%			EUR			44 897
DO BCP - EUR 0.0000%			EUR			31 040
						7 233 229

A PRAZO

Depósitos com pré aviso e a prazo

DP DP SANTAN 19/02 365D 0.1300% 2019-02-19 a 2020-02-19			EUR		11 411	10 011 411
DP DP SANTAN 05/06 365D 0.0600% 2019-06-05 a 2020-06-04			EUR		4 095	11 704 095
						21 715 506
						28 948 735

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

VALORES ACTIVOS

VALORES PASSIVOS

109 380
-2 060 555
-1 951 176
216 710 304

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO

RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

Em mercado regulamentado

Futuros

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
OEH0 EUR EUX 03/20	-98	133.63	EUR	133.63		-13 095 740
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					36 766 095.71	
Valor da Unidade de Participação:		€ 5.8943				