

CRÉDITO AGRÍCOLA VIDA - COMPANHIA DE SEGUROS, S.A.

R. Castilho, 233 - 7º 1099-004 Lisboa

M.C.R.C. e Pessoa Colectiva N.º 504405489

Fundo de Pensões Aberto CA Reforma Tranquila

31 de Dezembro de 2019

Valor da Unidade de Participação: 7,003

N.º de Unidades de Participação: 3.980.497,79925

Composição da Carteira em 31 de Dezembro de 2019

	Designação	Quantidade	Moeda	Cotação/ Preço Unit. em Euros	VALOR	Juros Decorridos (em Euros)	Montante Global (em Euros)
1	VALORES MOBILIÁRIOS COTADOS	19.627.754		0	23.232.027,39	81.479,72	23.313.507,11
1.1	Mercado de cotações oficiais de bolsa de valores portuguesa e outros mercado	3.742.000		0	4.203.129,43	36.961,95	4.240.091,38
1.1.1	Títulos de dívida pública	3.742.000		0	4.203.129,43	36.961,95	4.240.091,38
1.1.1	AZORES 1.006% 15/06/29	300.000	EUR	100,99	302.976,00	1.327,59	304.303,59
1.1.1	AZORES 1.85% 21/08/25	225.000	EUR	104,47	235.057,50	1.526,25	236.583,75
1.1.1	PGB 1.95% 15/06/29	3.217.000	EUR	113,93	3.665.095,93	34.108,11	3.699.204,04
1.2	Mercado de cotações oficiais de bolsa valores de outros Estados-membro da Un	15.785.754		0,00	18.927.474,96	44.484,02	18.971.958,98
1.2.1	Títulos de dívida pública	5.688.000		0,00	5.834.028,12	22.905,42	5.856.933,54
1.2.1	BTPS 1.35% 01/04/30	2.313.000	EUR	99,46	2.300.509,80	7.763,72	2.308.273,52
1.2.1	DBR 0% 15/08/50	519.000	EUR	89,87	466.446,06	0,00	466.446,06
1.2.1	PGB Float 02/08/22	367.000	EUR	104,08	381.973,60	1.905,73	383.879,33
1.2.1	PGB Float 12/04/22	340.000	EUR	104,30	354.620,00	1.152,22	355.772,22
1.2.1	PGB Float 12/08/21	426.000	EUR	103,35	440.271,00	3.420,42	443.691,42
1.2.1	PGB Float 30/11/21	434.000	EUR	103,80	450.492,00	747,44	451.239,44
1.2.1	PGB Floater 05/12/22	303.000	EUR	103,09	312.362,70	240,72	312.603,42
1.2.1	SPGB 1.85% 30/07/35	986.000	EUR	114,34	1.127.352,96	7.675,17	1.135.028,13
1.2.3	Obrigações diversas	9.772.000		0,00	9.868.894,60	21.578,60	9.890.473,20
1.2.3	ACAFP 4.5% 29/09/21	250.000	EUR	107,71	269.275,00	61,48	269.336,48
1.2.3	BACR 0.75% 09/06/25-24	250.000	EUR	100,076	250.190,00	112,70	250.302,70
1.2.3	BACR Float 26/04/21	300.000	EUR	99,78	299.349,00	55,83	299.404,83
1.2.3	BACRED Float 18/05/22	400.000	EUR	100,32	401.280,00	189,68	401.469,68
1.2.3	BAYNGR Float 26/06/22	300.000	EUR	100,26	300.765,00	5,07	300.770,07
1.2.3	BBVASM 0.375% 15/11/26	300.000	EUR	99,22	297.663,00	141,39	297.804,39
1.2.3	BKIASM 0.75% 09/07/26	200.000	EUR	100,04	200.074,00	717,21	200.791,21
1.2.3	BNP 0.5% 04/06/26-25	100.000	EUR	100,24	100.236,00	36,89	100.272,89
1.2.3	CCL 1.875% 11/07/22	400.000	EUR	105,36	421.432,00	1.106,56	422.538,56
1.2.3	CONGR 0% 12/09/23	150.000	EUR	99,13	148.701,00	0,00	148.701,00
1.2.3	CS Float 20/12/22	200.000	EUR	101,07	202.148,00	68,87	202.216,87
1.2.3	DE Float 03/10/22	200.000	EUR	100,05	200.106,00	0,00	200.106,00
1.2.3	DECFP Float 24/10/20	100.000	EUR	100,02	100.015,00	0,00	100.015,00
1.2.3	EDPPL 0% 12/11/23	200.000	EUR	96,64	193.280,00	0,00	193.280,00
1.2.3	EOANGR 0% 29/09/22	300.000	EUR	99,76	299.283,00	0,00	299.283,00
1.2.3	FCABNK Float 16/04/21	300.000	EUR	99,79	299.371,50	211,53	299.583,03
1.2.3	GS Float 26/09/23-22	100.000	EUR	100,19	100.185,00	2,47	100.187,47
1.2.3	HAR 2% 27/05/22	300.000	EUR	104,04	312.108,00	3.567,12	315.675,12
1.2.3	HSBC Float 05/10/23-22	200.000	EUR	99,97	199.940,00	36,25	199.976,25
1.2.3	IAGLN 0.5% 04/07/23	200.000	EUR	99,78	199.552,00	491,80	200.043,80
1.2.3	INTNED 0.1% 03/09/25-24	300.000	EUR	98,47	295.419,00	97,54	295.516,54
1.2.3	ISPIM 1% 19/11/26	300.000	EUR	99,66	298.977,00	344,26	299.321,26
1.2.3	JEF 1% 19/07/24	200.000	EUR	100,39	200.772,00	901,64	201.673,64
1.2.3	Lloyds Float 21/06/24	150.000	EUR	100,79	151.177,50	15,92	151.193,42
1.2.3	MS Float 08/11/22	300.000	EUR	100,51	301.518,00	129,85	301.647,85
1.2.3	NDAQ 1.75% 19/05/23	300.000	EUR	104,62	313.845,00	3.241,80	317.086,80
1.2.3	NHYN0 1.125% 11/04/25	200.000	EUR	102,55	205.108,00	1.622,95	206.730,95
1.2.3	NOSPL 1.125% 02/05/23	200.000	EUR	101,98	203.966,00	1.493,85	205.459,85
1.2.3	PKOBP 0.75% 25/07/21	440.000	EUR	101,07	444.699,20	1.433,61	446.132,81
1.2.3	RABOBK Float 27/04/21	432.000	EUR	103,90	448.826,40	2.419,20	451.245,60
1.2.3	RBS Float 27/09/21	300.000	EUR	100,78	302.331,00	16,73	302.347,73
1.2.3	RCFFP 1.5% 03/04/24	100.000	EUR	103,69	103.690,00	1.114,75	104.804,75
1.2.3	RENAUL 0.75% 10/04/23	200.000	EUR	100,56	201.118,00	1.086,07	202.204,07
1.2.3	RY 0.125% 23/07/24	500.000	EUR	99,40	497.000,00	274,93	497.274,93
1.2.3	SANTAN Float 21/03/22	100.000	EUR	101,02	101.021,00	17,56	101.038,56
1.2.3	SOCGEN Float 06/03/23	200.000	EUR	99,77	199.542,00	7,92	199.549,92
1.2.3	UBS Float 20/09/22-21	200.000	EUR	100,56	201.118,00	18,15	201.136,15
1.2.3	UCGIM 2 30/06/23	300.000	EUR	99,12	297.357,00	2,52	297.359,52
1.2.3	VW Float 01/08/22	300.000	EUR	102,15	306.456,00	534,50	306.990,50
1.2.5	Títulos de participação	1.150		0,00	117.346,00	0,00	117.346,00
1.2.5	Ishares JPM USD EM Bond UCITS ETF D	1.150	EUR	102,04	117.346,00	0,00	117.346,00
1.2.6	Unidades de participação de fundos de investimento fechados	324.604		0	3.107.206,24	0,00	3.107.206,24
1.2.6	ComStage ETF PSI 20	172.948	EUR	5,93	1.025.581,64	0,00	1.025.581,64
1.2.6	Ishares Euro Stoxx 50 UCITS ETF	7.383	EUR	37,8200	279.225,06	0,00	279.225,06
1.2.6	Ishares Stoxx Europe 600 Telecoms UCITS ETF (DE)	13.000	EUR	22,3200	290.160,00	0,00	290.160,00
1.2.6	Lyxor ETF Euro Stoxx 50	6.423	EUR	36,2800	233.026,44	0,00	233.026,44
1.2.6	UBS ETF-Blb Barclays US 10+Y Treasury Bond EUR	124.850	EUR	10,2460	1.279.213,10	0,00	1.279.213,10
1.3	Mercado de cotações oficiais de bolsas de Estado não membro da União Europei	100.000		0,0000	101.423,00	33,75	101.456,75
1.3.3	Obrigações diversas	100.000		0,0000	101.423,00	33,75	101.456,75
1.3.3	T Float 05/09/23	100.000	EUR	101,4230	101.423,00	33,75	101.456,75
3	UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO DE INSTITUIÇÕES DE INVESTIMENTO COLECTIVO	100.352		0,0000	2.671.092,43	0,00	2.671.092,43
3.1	Fundos harmonizados	100.102		0,0000	2.433.117,43	0,00	2.433.117,43
3.1	BNY Mellon Global Funds-Emerg Mkts Debt AE	57.551	EUR	2,1429	123.326,25	0,00	123.326,25
3.1	Candriam Equities L Europe OPT5	1.272	EUR	196,1300	249.444,02	0,00	249.444,02
3.1	DNCA Invest Miuri	725	EUR	116,8500	84.678,24	0,00	84.678,24
3.1	Fidelity Funds-European Dynamic Growth Fund-Y ACC	7.911	EUR	26,6700	210.978,10	0,00	210.978,10
3.1	Fidelity Funds-World Fund A	7.496	EUR	26,9200	201.796,09	0,00	201.796,09
3.1	IMGA European Equities - Fundo de Investimento Aberto de Ações	8.788	EUR	14,9854	131.685,59	0,00	131.685,59
3.1	Invesco Global Targeted Returns Eur	2.226	EUR	10,9892	24.458,00	0,00	24.458,00
3.1	JPMorgan Funds-Europe Strategic Growth -A-A	7.091	EUR	32,86	233.005,00	0,00	233.005,00
3.1	LM-WA Macro Opport BD	880	EUR	128,75	113.239,23	0,00	113.239,23
3.1	Legg Mason AF - EnTrustPermal Alternative Inc Strategy	1.669	EUR	100,14	167.113,03	0,00	167.113,03
3.1	Natix AM FDS-Seeyond MINV-IA	9	EUR	22056,15995	203.752,60	0,00	203.752,60
3.1	Nordea 1 SICAV-Emerg Mkts Bond Fund	873	EUR	141,03	123.100,15	0,00	123.100,15
3.1	Nordea 1 SICAV-Flexible Fixed Income Fund	462	EUR	113,52001	52.443,86	0,00	52.443,86
3.1	Pictet - Global Megatrend Selection-I	748	EUR	301,18	225.216,97	0,00	225.216,97
3.1	Pictet Multi Asset Global Opportunities	433	EUR	128,31001	55.559,89	0,00	55.559,89
3.1	Schroder Int. Selection Fund - Eur	1.971	EUR	118,4031	233.320,41	0,00	233.320,41
3.2	Fundos não harmonizados	250		0	237.975,00	0,00	237.975,00
3.2	Fundo Energia FCR - CAT B	250	EUR	951,9	237.975,00	0,00	237.975,00
4	IMOBILIÁRIO	9.685		0	170.621,61	0,00	170.621,61
4.2	Unidades de participação de fundos de investimento imobiliário	9.685		0	170.621,61	0,00	170.621,61

CRÉDITO AGRÍCOLA VIDA - COMPANHIA DE SEGUROS, S.A.

R. Castilho, 233 -7º 1099-004 Lisboa

M.C.R.C. e Pessoa Colectiva Nº 504405489

Fundo de Pensões Aberto CA Reforma Tranquila

31 de Dezembro de 2019

Valor da Unidade de Participação: 7,003

Nº de Unidades de Participação: 3.980.497,79925

Composição da Carteira em 31 de Dezembro de 2019

Designação	Quantidade	Moeda	Cotação/ Preço Unit. em Euros	VALOR	Juros Decorridos (em Euros)	Montante Global (em Euros)
4.2 CA Património Crescente	9.685	EUR	17,6171	170.621,61	0,00	170.621,61
5 LIQUIDEZ	0		0	1.720.185,49	0,00	1.720.185,49
5.1 À vista	0		0	2.043.487,96	0,00	2.043.487,96
5.1.2 Depósitos à ordem	0		0	2.043.487,96	0,00	2.043.487,96
5.1.2 EUR - BEST	0	EUR	0	91.195,48	0,00	91.195,48
5.1.2 EUR - CCCAM	0	EUR	0	1.562.855,81	0,00	1.562.855,81
5.1.2 EUR - FUTUROS - ALTURA	0	EUR	0	368.632,58	0,00	368.632,58
5.1.2 EUR - FUTUROS - CMG ALTURA	0	EUR	0	20.804,09	0,00	20.804,09
5.3 Devedores e Credores	0		0	-323.302,47	0,00	-323.302,47
5.3.1 Operações a Liquidar	0		0	-240.000,04	0,00	-240.000,04
5.3.1 Diferimento do Juro das OPLs	0	EUR	0	-0,04	0,00	-0,04
5.3.1 Liquidação Parcial Operações	0	EUR	0	-240.000,00	0,00	-240.000,00
5.3.2 Impostos	0		0	5.942,94	0,00	5.942,94
5.3.2 FP - IRS - Cat E	0	EUR	0	-221,45	0,00	-221,45
5.3.2 FP - IRS categoria H	0	EUR	0	-170,00	0,00	-170,00
5.3.2 Imposto a recuperar - Portugal	0	EUR	0	9.904,11	0,00	9.904,11
5.3.2 Imposto de Selo - FP - CD	0	EUR	0	-214,74	0,00	-214,74
5.3.2 Imposto do Selo - FP CG	0	EUR	0	-3.354,98	0,00	-3.354,98
5.3.3 Comissões	0		0	-89.245,37	0,00	-89.245,37
5.3.3 FP - Comissão de Depósito	0	EUR	0	-5.368,18	0,00	-5.368,18
5.3.3 FP - Comissão de Gestão	0	EUR	0	-83.877,19	0,00	-83.877,19
7 OPERAÇÕES COM PRODUTOS DERIVADOS	-8		0	0,00	0,00	0,00
7.1 Em mercado regulamentado	-8		0	0,00	0,00	0,00
7.1.1 Futuros	-8		0	0,00	0,00	0,00
7.1.1 EURO STOXX 50 MAR 20(FESX-ALTURA)	-8	EUR	3729	0,00	0,00	0,00
TOTAL		EUR		27.793.926,92	81.479,72	27.875.406,64