



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em: 2021-09-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
AÇÕES						12 854 364	10.96
AÇÕES EUA						192	0.00
AÇÕES EUA - INV. DIRETO						0	0.00
ESZ1 S&P500 12/21	91004070050	3.00	4 313.50		USD	0	0.00
AÇÕES EUA - INV. INDIRETO						192	0.00
TROWE ROWE PRICE I	LU0133088293	1.00	29.11		USD	25	0.00
MORGAN-US AD-Z\$	LU0360484686	1.00	193.44		USD	167	0.00
AÇÕES EUROPEIAS						12 279 001	10.47
AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO						3 743 509	3.19
EDP Renováveis	ES0127797019	1 782.00	21.42		EUR	38 170	0.03
VGZ1 EUR EUX 12/21	DE000C4SA6R6	15.00	4 019.00		EUR	0	0.00
BMW	DE0005190003	335.00	82.76		EUR	27 725	0.02
DEUTSCHE BANK	DE0005140008	2 621.00	11.04		EUR	28 931	0.02
SIEMENS	DE0007236101	1 037.00	141.92		EUR	147 171	0.13
ALLIANZ	DE0008404005	394.00	194.84		EUR	76 767	0.07
BASF	DE000BASF111	910.00	65.85		EUR	59 924	0.05
BAYER AG	DE000BAY0017	1 678.00	47.01		EUR	78 874	0.07
RWE-RHEINISCH WEST..	DE0007037129	438.00	30.55		EUR	13 381	0.01
MUNCHENER RUCKVERS.	DE0008430026	119.00	236.90		EUR	28 191	0.02
ADIDAS- SALOMON AG	DE000A1EWWWO	153.00	271.80		EUR	41 585	0.04
SAP SE	DE0007164600	1 020.00	116.88		EUR	119 218	0.10
DEUTSCHE TELEKOM	DE0005557508	3 813.00	17.40		EUR	66 331	0.06
DAIMLER CHRYSLER	DE0007100000	973.00	76.72		EUR	74 649	0.06
INFINEON TECHNOLOGIE	DE0006231004	770.00	35.53		EUR	27 354	0.02
DEUTSCHE POST	DE0005552004	2 050.00	54.48		EUR	111 684	0.10
DEUTSCHE BOERSE AG	DE0005810055	200.00	140.50		EUR	28 100	0.02
VOLKSWAGEN AG-PREF.	DE0007664039	162.00	193.64		EUR	31 370	0.03
FRESENIUS SE&CO KGAA	DE0005785604	639.00	41.54		EUR	26 541	0.02
SIEMENS HEALTHIN	DE000SHL1006	688.00	56.18		EUR	38 652	0.03
DANONE	FR0000120644	767.00	59.05		EUR	45 291	0.04
AXA-UAP	FR0000120628	2 023.00	24.09		EUR	48 724	0.04
PERNOD RICARD	FR0000120693	355.00	190.70		EUR	67 699	0.06
TotalEnergies SE	FR0000120271	1 884.00	41.34		EUR	77 875	0.07
L OREAL	FR0000120321	355.00	356.85		EUR	126 682	0.11
Kering	FR0000121485	82.00	616.00		EUR	50 512	0.04
BNP	FR0000131104	1 379.00	55.44		EUR	76 452	0.07
AIR LIQUIDE	FR0000120073	453.00	138.58		EUR	62 777	0.05
SCHNEIDER	FR0000121972	293.00	143.90		EUR	42 163	0.04



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em: 2021-09-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
L.V.M.H.	FR0000121014	317.00	620.10		EUR	196 572	0.17
MICHELIN	FR0000121261	173.00	132.80		EUR	22 974	0.02
SAINT-GOBAIN	FR0000125007	853.00	58.24		EUR	49 679	0.04
SOCIETE GENERALE	FR0000130809	1 064.00	27.20		EUR	28 935	0.02
EssilorLuxottica	FR0000121667	285.00	165.50		EUR	47 168	0.04
GLE ENTREP. VINCI	FR0000125486	610.00	90.15		EUR	54 992	0.05
ST MICROELECTRON	NL0000226223	486.00	37.77		EUR	18 354	0.02
DASSAULT SYSTEMES	FR0014003TT8	610.00	45.47		EUR	27 734	0.02
SANOFI SYNHLABO	FR0000120578	976.00	83.08		EUR	81 086	0.07
AIRBUS SE	NL0000235190	729.00	115.10		EUR	83 908	0.07
CREDIT AGRICOLE SA	FR0000045072	1 582.00	11.95		EUR	18 899	0.02
ILIAD SA	FR0004035913	204.00	182.00		EUR	37 128	0.03
SAFRAN SA	FR0000073272	177.00	109.66		EUR	19 410	0.02
HERMES INTERNACIONAL	FR0000052292	30.00	1 196.50		EUR	35 895	0.03
TELEPERFORMANCE	FR0000051807	78.00	340.10		EUR	26 528	0.02
RECKITT BENCKISER	GB00B24CGK77	369.00	58.30		GBP	25 028	0.02
ANGLO AMERICAN PLC	GB00B1XZS820	826.00	26.23		GBP	25 201	0.02
OCADO GROUP PLC	GB00B3MBS747	1 134.00	16.63		GBP	21 933	0.02
AMADEUS HOLDING SA	ES0109067019	506.00	56.88		EUR	28 781	0.02
TELEFONICA	ES0178430E18	4 623.00	4.05		EUR	18 709	0.02
BCO SANTANDER C.HISP	ES0113900J37	18 231.00	3.14		EUR	57 182	0.05
IBERDROLA	ES0144580Y14	6 140.00	8.68		EUR	53 320	0.05
BCO. BILBAO VISCAYA	ES0113211835	5 040.00	5.72		EUR	28 814	0.02
FERROVIAL	ES0118900010	627.00	25.23		EUR	15 819	0.01
INDITEX	ES0148396007	1 672.00	31.82		EUR	53 203	0.05
CELLNEX TELECOM SAU	ES0105066007	534.00	53.30		EUR	28 462	0.02
Siemens Gamesa R	ES0143416115	505.00	22.02		EUR	11 120	0.01
GENERALI ASSUC.	IT0000062072	1 042.00	18.39		EUR	19 162	0.02
UNICREDITO ITALIANO	IT0005239360	2 573.00	11.50		EUR	29 590	0.03
ENI SPA	IT0003132476	864.00	11.55		EUR	9 976	0.01
BANCA INTESA	IT0000072618	15 620.00	2.45		EUR	38 324	0.03
ENEL	IT0003128367	8 341.00	6.65		EUR	55 476	0.05
ESSITY AKTIEBO-B	SE0009922164	847.00	272.00		SEK	22 714	0.02
ZURICH ALLIED AG	CH0011075394	54.00	383.60		CHF	19 158	0.02
ING GROEP NV	NL0011821202	3 942.00	12.57		EUR	49 543	0.04
ASML NA	NL0010273215	423.00	645.90		EUR	273 216	0.23
AKZO NOBEL NV NLG20	NL0013267909	408.00	94.38		EUR	38 507	0.03
DSM NV	NL0000009827	278.00	172.75		EUR	48 025	0.04
STELLANTIS NV	NL00150001Q9	4 487.00	16.52		EUR	74 134	0.06
Prosus NV	NL0013654783	592.00	68.99		EUR	40 842	0.03



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em: 2021-09-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
Adyen NV	NL0012969182	17.00	2 415.00		EUR	41 055	0.04
NOKIA A	FI0009000681	5 964.00	4.76		EUR	28 383	0.02
SAMPO OYJ-A SHS	FI0009003305	668.00	42.91		EUR	28 664	0.02
Neste Oyj	FI0009013296	358.00	48.97		EUR	17 531	0.01
KBC BANKVERZEKERING	BE0003565737	381.00	78.04		EUR	29 733	0.03
ANHEUSER-BUSCH INB	BE0974293251	966.00	49.15		EUR	47 474	0.04
ERST BK DER OEST.SPA	AT0000652011	512.00	38.06		EUR	19 487	0.02
CRH ORD	IE0001827041	811.00	40.56		EUR	32 894	0.03
AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO						8 535 492	7.28
ALLIANZ RCM EUR EQTY	LU0852482198	1 061.01	2 687.70		EUR	2 851 685	2.43
AB SCV I-EUZ EQ I	LU0528103707	84 388.10	34.11		EUR	2 878 478	2.45
SCHRO-EU EQ-IZE	LU2004793787	51 160.86	54.83		EUR	2 805 329	2.39
AÇÕES EMERGENTES						575 171	0.49
AÇÕES EMERGENTES - INV. INDIRETO						575 171	0.49
ISHARES MSCI EMER.MK	US4642872349	13 170.00	50.56		USD	575 171	0.49
OBRIGAÇÕES						82 415 931	70.28
OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO						78 825 335	67.22
OBRIGAÇÕES GOVERNOS						18 365 050	15.66
DBR 1.5% 02/2023	DE0001102309	954 000.00	103.06%	8 939	EUR	992 122	0.85
DBR 1.25% 08/48	DE0001102432	27 000.00	126.43%	43	EUR	34 180	0.03
DBR 0% 08/2050	DE0001102481	15 000.00	92.35%		EUR	13 853	0.01
BKO 0% 09/2022	DE0001104818	509 000.00	100.65%		EUR	512 303	0.44
FRTR 4.25% 10/2023	FR0010466938	289 000.00	110.22%	11 475	EUR	330 011	0.28
FRTR 3% 04/2022	FR0011196856	1 633 000.00	102.06%	21 341	EUR	1 687 997	1.44
FRTR 0.25% 11/26	FR0013200813	4 354 000.00	103.33%	9 245	EUR	4 508 102	3.84
SPGB 1.95% 07/2030	ES00000127A2	275 000.00	114.75%	926	EUR	316 499	0.27
SPGB 3.45% 07/66	ES00000128E2	439 000.00	153.47%	2 614	EUR	676 330	0.58
SPGB 0.45% 10/22	ES0000012A97	1 647 000.00	101.16%	6 802	EUR	1 672 842	1.43
BTPS 2% 12/2025	IT0005127086	1 881 000.00	108.39%	12 540	EUR	2 051 281	1.75
BTPS 1,7% 09/2051	IT0005425233	1 000 000.00	97.48%	1 409	EUR	976 239	0.83
BTPS 0.95% 12/2031	IT0005449969	1 000 000.00	100.43%	3 167	EUR	1 007 497	0.86
RAGB 0% 07/2023	AT0000A1PE50	1 084 000.00	101.29%		EUR	1 098 016	0.94
IRISH 0% 10/22	IE00BDHDPQ37	337 000.00	100.62%		EUR	339 076	0.29
KOREA 0% 09/2025	XS2226969686	200 000.00	100.54%		EUR	201 080	0.17
KFW 0% 04/2024	DE000A2LQSP7	422 000.00	101.38%		EUR	427 815	0.36
CCTS Float 07/2023	IT0005185456	1 300 000.00	101.19%	527	EUR	1 315 945	1.12
EU 0% 07/2026	EU000A3KTGV8	200 000.00	101.93%		EUR	203 864	0.17
OBRIGAÇÕES CRÉDITO						60 460 284	51.56
DAIGR Float 07/24	DE000A2GSCY9	600 000.00	100.67%		EUR	604 032	0.52
VW Float 12/21	XS1830992563	1 700 000.00	100.09%	164	EUR	1 701 762	1.45



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em: 2021-09-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
PBBGR Float 07/28/23	DE000A2YNV36	1 000 000.00	100.98%	643	EUR	1 010 433	0.86
DB Float 05/2022	DE000DL19TQ2	2 400 000.00	100.35%	757	EUR	2 409 205	2.05
ACAFP Float 04/22	XS1598861588	1 500 000.00	100.41%	767	EUR	1 506 902	1.29
SOCGEN Float 05/24	XS1616341829	1 600 000.00	101.51%	433	EUR	1 624 545	1.39
BNP Float 06/24	XS1626933102	1 000 000.00	101.52%	135	EUR	1 015 345	0.87
RENAUL Float 03/2022	FR0013260486	400 000.00	100.19%	24	EUR	400 788	0.34
GFCFP Float 06/22	FR0013266343	500 000.00	100.26%		EUR	501 310	0.43
RENAULT Float 11/24	FR0013292687	400 000.00	100.34%	17	EUR	401 369	0.34
BNP Float 05/23	XS1823532996	300 000.00	100.83%	23	EUR	302 516	0.26
CAFP Float 09/2023	FR0013446580	1 900 000.00	100.59%	102	EUR	1 911 388	1.63
LLOYDS Float 06/2024	XS1633845158	1 000 000.00	101.56%	64	EUR	1 015 704	0.87
HSBC Float 10/23	XS1681855539	1 500 000.00	100.36%		EUR	1 505 370	1.28
CCE FLOAT 11/21	XS1717567587	800 000.00	100.05%		EUR	800 360	0.68
BACR Float 05/2026	XS2342059784	1 600 000.00	102.20%	1 007	EUR	1 636 255	1.40
HSBC Float 09/2026	XS2388490802	1 900 000.00	102.11%	168	EUR	1 940 334	1.65
IBESM Float 02/24	XS1564443759	1 200 000.00	100.80%	171	EUR	1 209 723	1.03
SANTAN Float 03/22	XS1578916261	1 000 000.00	100.43%	131	EUR	1 004 421	0.86
BBVASM Float 04/22	XS1594368539	1 000 000.00	100.29%	122	EUR	1 003 052	0.86
AMSSM Float 03/22	XS1878190757	700 000.00	100.02%		EUR	700 140	0.60
SANTAN Float 03/23	XS1689234570	500 000.00	100.90%	9	EUR	504 524	0.43
ISPIM Float 04/22	XS1599167589	1 000 000.00	100.48%	826	EUR	1 005 596	0.86
BACRED Float 05/22	XS1615501837	1 000 000.00	100.39%	306	EUR	1 004 196	0.86
WFC Float 01/22	XS1558022866	1 400 000.00	100.16%		EUR	1 402 198	1.20
BAC Float 05/23	XS1602557495	150 000.00	100.38%	57	EUR	150 627	0.13
MS Float 11/22	XS1603892065	1 200 000.00	100.06%	283	EUR	1 201 039	1.02
GS Float 09/23	XS1691349523	800 000.00	100.35%	7	EUR	802 807	0.68
F Float 12/21	XS1729872652	1 000 000.00	99.86%		EUR	998 640	0.85
F Float 12/24	XS1729872736	550 000.00	98.14%	69	EUR	539 850	0.46
F Float 12/22	XS1767930826	300 000.00	99.53%		EUR	298 602	0.25
C Float 03/23	XS1795253134	1 650 000.00	100.61%		EUR	1 660 115	1.42
GM Float 03/22	XS1792505197	300 000.00	100.13%	0	EUR	300 375	0.26
BAC FLOAT 04/24	XS1811433983	1 400 000.00	100.71%	393	EUR	1 410 319	1.20
T Float 09/23	XS1907118464	1 500 000.00	101.12%	302	EUR	1 517 027	1.29
GS Float 04/2023	XS2107332483	500 000.00	100.19%	2	EUR	500 947	0.43
BAC Float 09/2026	XS2387929834	2 000 000.00	102.01%	228	EUR	2 040 408	1.74
CS Float 01/2026	CH0591979635	2 000 000.00	101.32%	1 942	EUR	2 028 262	1.73
DAIGR Float 05/22	DE000A19HBM3	500 000.00	100.22%		EUR	501 085	0.43
BAYNGR Float 06/22	XS1840614736	1 500 000.00	100.26%	1	EUR	1 503 856	1.28
INTNED Float 09/23	XS1882544205	600 000.00	101.43%	56	EUR	608 618	0.52
ANNGR Float 12/2022	DE000A19X793	1 600 000.00	100.40%		EUR	1 606 416	1.37



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em: 2021-09-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
NYKRE Float 06/22	DK0009514473	700 000.00	100.27%	12	EUR	701 867	0.60
NYKRE Flt. 01/24	DK0009520520	300 000.00	100.54%		EUR	301 608	0.26
SBBSS Float 2/2023	XS2293906199	1 300 000.00	100.13%	230	EUR	1 301 868	1.11
KBCBB Float 11/22	BE0002281500	1 600 000.00	100.53%	3	EUR	1 608 403	1.37
ABIBB Float 04/24	BE6301509012	1 600 000.00	100.62%		EUR	1 609 952	1.37
DLTAS 2008-1 A	XS0390756285	245 903.78	99.86%		EUR	245 554	0.21
DHR Float 06/22	XS1637162246	950 000.00	100.25%		EUR	952 385	0.81
DE FLOAT 10/22	XS1692846790	2 100 000.00	100.40%		EUR	2 108 421	1.80
SUMIBK Float 06/22	XS1621087359	1 500 000.00	100.29%		EUR	1 504 410	1.28
TACHEM Float 11/22	XS1843449809	1 600 000.00	101.04%	953	EUR	1 617 641	1.38
MUFG Float 05/2023	XS1828132735	1 400 000.00	100.60%		EUR	1 408 442	1.20
CBAAU Float 03/2023	XS1789454326	700 000.00	100.71%		EUR	704 984	0.60
GS Float 07/2022	XS1173867323	600 000.00	100.63%	504	EUR	604 290	0.52
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO						3 590 596	3.06
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO - CORPORATE						3 590 596	3.06
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	LU0141799097	45 156.24	40.31		EUR	1 820 248	1.55
ISHARES EUR CORP.BON	IE0032523478	12 658.00	139.86		EUR	1 770 348	1.51
ALTERNATIVOS						898 288	0.77
CAIXA PRIVATE EQUITY	PTYME4LE0005	40 509.00	6.22		EUR	252 088	0.21
CAIXA INFRAESTRUTURA	PTYME7LE0002	82 413.00	7.84		EUR	646 200	0.55
IMOBILIÁRIO						16 615 527	14.17
IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO						5 000 600	4.26
REPUBLICA 35- R/C	P50040000002	8.00			EUR	5 000 600	4.26
IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO						11 614 927	9.91
CXG IMOBILIARIO	PTYMESHE0009	710 909.00	4.25		EUR	3 019 941	2.58
Fundimo	PTYCXTHM0007	1 074 997.00	7.99		EUR	8 593 849	7.33
TISHMAN ESOF	14300000004	91 579.00	0.01		EUR	1 137	0.00
LIQUIDEZ						4 476 129	3.82
TOTAL						117 260 238	100.00

Saldos de Unidades de Participação

	Peso (%)	Valor (EUR)
Valor (EUR)	100.00	117 260 238.310000
Quantidade		8 398 092.042879
Cotação 2021-10-01 (EUR)		13.962700



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em: 2021-09-30

Câmbios

CHF / EUR	0.924873
DKK / EUR	0.134465
EUR / EUR	1.000000
GBP / EUR	1.163386
NOK / EUR	0.098820
SEK / EUR	0.098592
USD / EUR	0.863782