



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA MODERADO
Composição da Carteira em: 2022-07-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
AÇÕES						10 837 727	31.17
AÇÕES EUA						2 755 927	7.93
AÇÕES EUA - INV. DIRETO						0	0.00
ESU2 S&P500 09/22	91004070053	3.00	4 109.00		USD	0	0.00
AÇÕES EUA - INV. INDIRETO						2 755 927	7.93
T ROWE ROWE PRICE QR	LU1136108674	27 745.89	27.53		EUR	763 844	2.20
MORGAN-US AD-Z\$	LU0360484686	9 082.78	89.95		USD	800 820	2.30
ISHARES S&P500 VALUE	US4642874089	5 819.00	145.03		USD	827 220	2.38
ISH MSCI PAC XJP	IE00B52MJY50	2 293.00	161.97		USD	364 044	1.05
AÇÕES ÁSIA						1 186 632	3.41
AÇÕES ÁSIA - INV. INDIRETO						1 186 632	3.41
T ROWE PRICE-JAP EQY	LU0230817925	40 671.90	15.88		EUR	645 870	1.86
X MSCI JAPAN EUR	LU0659580079	21 713.00	24.91		EUR	540 762	1.56
AÇÕES EUROPEIAS						5 904 560	16.98
AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO						1 862 006	5.36
EDP Renováveis	ES0127797019	1 001.00	25.30		EUR	25 325	0.07
VGU2 EUR EUX 09/22	DE000C5SKSC4	14.00	3 705.00		EUR	0	0.00
BMW	DE0005190003	181.00	79.48		EUR	14 386	0.04
COMMERZBANK	DE000CBK1001	1 180.00	6.68		EUR	7 880	0.02
SIEMENS	DE0007236101	509.00	108.54		EUR	55 247	0.16
ALLIANZ	DE0008404005	142.00	177.32		EUR	25 179	0.07
E.ON AG(EX VEBA AG)	DE000ENAG999	1 305.00	8.77		EUR	11 445	0.03
BASF	DE000BASF111	338.00	43.42		EUR	14 674	0.04
BAYER AG	DE000BAY0017	596.00	57.00		EUR	33 972	0.10
RWE-RHEINISCH WEST..	DE0007037129	363.00	40.18		EUR	14 585	0.04
ADIDAS- SALOMON AG	DE000A1EWWWO	86.00	167.80		EUR	14 431	0.04
MERCK KGAA	DE0006599905	77.00	185.70		EUR	14 299	0.04
SAP SE	DE0007164600	423.00	90.68		EUR	38 358	0.11
DEUTSCHE TELEKOM	DE0005557508	2 469.00	18.51		EUR	45 691	0.13
Mercedes-Benz Grp AG	DE0007100000	504.00	57.22		EUR	28 839	0.08
INFINEON TECHNOLOGIE	DE0006231004	325.00	26.55		EUR	8 629	0.02
DEUTSCHE POST	DE0005552004	738.00	38.90		EUR	28 708	0.08
DEUTSCHE BOERSE AG	DE0005810055	136.00	170.50		EUR	23 188	0.07
VOLKSWAGEN AG-PREF.	DE0007664039	122.00	137.30		EUR	16 751	0.05
DANONE	FR0000120644	237.00	53.81		EUR	12 753	0.04
AXA-UAP	FR0000120628	413.00	22.45		EUR	9 272	0.03
CARREFOUR	FR0000120172	699.00	16.64		EUR	11 631	0.03
PERNOD RICARD	FR0000120693	155.00	191.50		EUR	29 683	0.09



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA MODERADO
Composição da Carteira em: 2022-07-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
TotalEnergies SE	FR0000120271	1 238.00	49.76		EUR	61 603	0.18
L OREAL	FR0000120321	135.00	368.10		EUR	49 694	0.14
Kering	FR0000121485	40.00	556.90		EUR	22 276	0.06
BNP	FR0000131104	349.00	46.00		EUR	16 054	0.05
AIR LIQUIDE	FR0000120073	322.00	134.12		EUR	43 187	0.12
SCHNEIDER	FR0000121972	223.00	134.54		EUR	30 002	0.09
L.V.M.H.	FR0000121014	160.00	675.00		EUR	108 000	0.31
MICHELIN	FR001400AJ45	628.00	27.17		EUR	17 060	0.05
SAINT-GOBAIN	FR0000125007	536.00	45.33		EUR	24 294	0.07
THOMSON	FR0000121329	138.00	121.35		EUR	16 746	0.05
SOCIETE GENERALE	FR0000130809	1 373.00	21.84		EUR	29 979	0.09
CAP GEMINI SOGETI	FR0000125338	180.00	185.35		EUR	33 363	0.10
EssilorLuxottica	FR0000121667	145.00	152.45		EUR	22 105	0.06
GLE ENTREP. VINCI	FR0000125486	309.00	93.38		EUR	28 854	0.08
SANOFI SYNHLABO	FR0000120578	551.00	97.21		EUR	53 563	0.15
VEOLIA ENVIRONEMENT	FR0000124141	482.00	24.37		EUR	11 746	0.03
AIRBUS SE	NL0000235190	409.00	104.88		EUR	42 896	0.12
SAFRAN SA	FR0000073272	91.00	106.98		EUR	9 735	0.03
HERMES INTERNACIONAL	FR0000052292	24.00	1 334.00		EUR	32 016	0.09
TELEPERFORMANCE	FR0000051807	29.00	326.30		EUR	9 463	0.03
BRIT.PETROLEUM AMOCO	GB0007980591	1 895.00	4.00		GBP	9 052	0.03
RECKITT BENCKISER	GB00B24CGK77	187.00	66.46		GBP	14 841	0.04
OCADO GROUP PLC	GB00B3MBS747	850.00	8.39		GBP	8 520	0.02
GLENCORE PLC	JE00B4T3BW64	1 806.00	4.62		GBP	9 960	0.03
ASSTEAD GROUP PLC	GB0000536739	168.00	45.91		GBP	9 210	0.03
AMADEUS HOLDING SA	ES0109067019	421.00	56.68		EUR	23 862	0.07
SHELL PLC-NEW	GB00BP6MXD84	349.00	25.96		EUR	9 060	0.03
TELEFONICA	ES0178430E18	4 395.00	4.36		EUR	19 149	0.06
BCO SANTANDER C.HISP	ES0113900J37	7 079.00	2.44		EUR	17 273	0.05
FERROVIAL	ES0118900010	380.00	26.08		EUR	9 910	0.03
INDITEX	ES0148396007	882.00	23.69		EUR	20 895	0.06
CAIXABANK SA	ES0140609019	10 517.00	2.93		EUR	30 804	0.09
CELLNEX TELECOM SAU	ES0105066007	372.00	43.59		EUR	16 215	0.05
GENERALI ASSUC.	IT0000062072	910.00	14.59		EUR	13 272	0.04
UNICREDITO ITALIANO	IT0005239360	3 585.00	9.58		EUR	34 344	0.10
ENI SPA	IT0003132476	1 757.00	11.72		EUR	20 585	0.06
ENEL	IT0003128367	4 026.00	4.91		EUR	19 764	0.06
TELE2 AB - B SHS	SE0005190238	772.00	115.95		SEK	8 611	0.02
ESSITY AKTIEBO-B	SE0009922164	376.00	258.00		SEK	9 332	0.03
C.FIN.RICHMONT	CH0210483332	88.00	113.95		CHF	10 331	0.03



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA MODERADO
Composição da Carteira em: 2022-07-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
KONINKLIJKE AHOLD NV	NL0011794037	720.00	26.89		EUR	19 357	0.06
ING GROEP NV	NL0011821202	4 537.00	9.49		EUR	43 061	0.12
KONINKLIJKE PHILIPS	NL0000009538	668.00	20.16		EUR	13 464	0.04
ASML NA	NL0010273215	260.00	555.40		EUR	144 404	0.42
AKZO NOBEL NV NLG20	NL0013267909	149.00	65.78		EUR	9 801	0.03
DSM NV	NL0000009827	156.00	155.90		EUR	24 320	0.07
STELLANTIS NV	NL00150001Q9	2 196.00	13.92		EUR	30 573	0.09
ASR NEDERLAND NV	NL0011872643	452.00	40.70		EUR	18 396	0.05
NOKIA A	FI0009000681	6 039.00	5.10		EUR	30 793	0.09
SAMPO OYJ-A SHS	FI0009003305	461.00	42.14		EUR	19 427	0.06
ERST BK DER OEST.SPA	AT0000652011	899.00	24.70		EUR	22 205	0.06
CRH ORD	IE0001827041	632.00	37.43		EUR	23 653	0.07
AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO						4 042 553	11.63
ALLIANZ RCM EUR EQTY	LU0852482198	485.46	2 111.75		EUR	1 025 170	2.95
SCHRO-EU EQ-IZE	LU2004793787	23 305.85	49.26		EUR	1 148 139	3.30
EU STEQ-SI/ANPFE	LU1799977381	4 149.64	123.98		EUR	514 473	1.48
AB I-EUZ EQ S1€	LU0528104002	10 343.48	31.36		EUR	324 372	0.93
ISHARES SMI CH	CH0008899764	1 826.00	115.84		CHF	217 931	0.63
ISHARES PLC FTSE 100	IE0005042456	57 045.00	7.27		GBP	495 158	1.42
UBS-MSCI EMU V-A	LU0446734369	8 856.00	35.83		EUR	317 310	0.91
AÇÕES EMERGENTES						990 608	2.85
AÇÕES EMERGENTES - INV. INDIRETO						990 608	2.85
GS-EMRG MKT E-I AC	LU1357028627	27 702.55	17.78		EUR	492 551	1.42
WELL-EM MK RE-S€	LU2058844833	56 683.67	8.79		EUR	498 057	1.43
OBRIGAÇÕES						15 917 480	45.78
OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO						6 385 711	18.37
OBRIGAÇÕES GOVERNOS						907 505	2.61
OT 2.875% 10/2025	PTOTEKOE0011	18 000.00	106.97%	411	EUR	19 666	0.06
DBR 0.25% 02/27	DE0001102416	32 000.00	99.31%	37	EUR	31 815	0.09
OBL 0% 10/2024	DE0001141802	133 000.00	99.38%		EUR	132 169	0.38
FRTR 0% 03/2025	FR0013415627	182 000.00	98.52%		EUR	179 303	0.52
FRTR 0% 02/2027	FR0014003513	35 000.00	96.67%		EUR	33 833	0.10
SPGB 0% 05/2024	ES0000012H33	86 000.00	98.93%		EUR	85 078	0.24
SPGB 0% 01/2027	ES0000012J15	47 000.00	95.28%		EUR	44 782	0.13
BTPS 0% 08/2026	IT0005454241	31 000.00	92.17%		EUR	28 573	0.08
BTPS 0% 12/2024	IT0005474330	195 000.00	96.41%		EUR	188 005	0.54
NETHER 0% 01/2026	NL0015000QL2	30 000.00	97.96%		EUR	29 387	0.08
RFGB 0% 09/2024	FI4000391529	15 000.00	99.04%		EUR	14 856	0.04
BGB 0.5% 10/2024	BE0000342510	69 000.00	100.35%	267	EUR	69 506	0.20
RAGB 0% 04/2025	AT0000A2QRW0	35 000.00	98.52%		EUR	34 482	0.10



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA MODERADO
Composição da Carteira em: 2022-07-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES GOVERNOS

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
IRISH 5.4% 03/2025	IE00B4TV0D44	14 000.00	112.55%	292	EUR	16 049	0.05
OBRIGAÇÕES CRÉDITO						5 478 206	15.76
GALPPL 2% 01/2026	PTGALCOM0013	100 000.00	96.52%	1 085	EUR	97 609	0.28
BCPPL 1.125% 02/2027	PTBCPHOM0066	100 000.00	83.07%	524	EUR	83 594	0.24
FIDELI 4.25% 09/2031	PTFIDBOM0009	100 000.00	91.25%	3 854	EUR	95 103	0.27
CXGD 0.375% 09/2027	PTCGDCOM0037	100 000.00	89.82%	323	EUR	90 139	0.26
MRKGR 1.625% 06/2079	XS2011260531	100 000.00	96.94%	1 006	EUR	97 947	0.28
ADSGR 0% 09/2024	XS2224621347	100 000.00	97.76%		EUR	97 762	0.28
DB 1% 11/2025	DE000DL19VR6	100 000.00	95.76%	699	EUR	96 457	0.28
NRPBBGR 0.1% 02/2026	DE000A3H2ZX9	100 000.00	89.94%	49	EUR	89 987	0.26
VW 0.125% 02/2027	XS2374595044	100 000.00	89.78%	58	EUR	89 842	0.26
BASGR 3,125% 06/28	XS2491542374	100 000.00	104.13%	283	EUR	104 412	0.30
PEUGOT 2.375% 04/23	FR0013153707	100 000.00	100.66%	709	EUR	101 366	0.29
RENAUL 0.75% 04/2023	FR0013412699	100 000.00	99.25%	232	EUR	99 484	0.29
SWFP 0.5% 01/2024	XS2203995910	100 000.00	98.43%	268	EUR	98 694	0.28
BNP 0.25% 04/2027	FR0014002X43	100 000.00	92.47%	75	EUR	92 548	0.27
SSELN 1.75% 09/2023	XS1287779208	100 000.00	100.33%	1 568	EUR	101 902	0.29
HSBC 1.5% 12/2024	XS1917601582	100 000.00	99.72%	986	EUR	100 703	0.29
LLOYDS 0.375% 01/25	XS2109394077	100 000.00	97.02%	190	EUR	97 205	0.28
BPLN 3.25% PERP	XS2193661324	100 000.00	94.97%	356	EUR	95 323	0.27
VMUKLN 2.875% 06/25	XS2126084750	100 000.00	99.82%	299	EUR	100 114	0.29
NWG 1.375% 03/2027	XS2449911143	100 000.00	96.05%	573	EUR	96 620	0.28
MRLSM 2.225% 04/23	XS1398336351	100 000.00	100.23%	597	EUR	100 830	0.29
KUTXAB 0.5% 09/2024	ES0343307015	100 000.00	96.77%	425	EUR	97 193	0.28
SANSCF 0.375% 01/25	XS2100690036	100 000.00	96.27%	201	EUR	96 467	0.28
CLNXSM 0.75% 11/2026	XS2300292617	100 000.00	89.85%	532	EUR	90 386	0.26
UCAJLN 4.5% 06/2025	ES0380907057	100 000.00	101.99%	395	EUR	102 380	0.29
SWEDA 0.25% 10/2024	XS2063261155	100 000.00	97.02%	203	EUR	97 226	0.28
TRNIM 1% 07/2023	XS1858912915	100 000.00	99.65%	25	EUR	99 677	0.29
ISPIM 1% 07/2024	XS2022425297	100 000.00	98.08%	77	EUR	98 159	0.28
KHC 1.5% 05/24	XS1405782407	100 000.00	99.81%	284	EUR	100 098	0.29
JPM 0.625% 01/2024	XS1456422135	100 000.00	98.62%	322	EUR	98 944	0.28
MS 1.875% 03/23	XS1115208107	100 000.00	100.52%	637	EUR	101 159	0.29
UPS 0.375% 11/23	XS1718480327	100 000.00	99.25%	266	EUR	99 514	0.29
EMR 0.375% 05/2024	XS1999902502	100 000.00	98.17%	73	EUR	98 243	0.28
ITW 0.25% 12/2024	XS1843435253	100 000.00	97.66%	164	EUR	97 825	0.28
F 1.514% 02/2023	XS2013574202	100 000.00	99.70%	684	EUR	100 383	0.29
JEF 1% 07/2024	XS2030530450	100 000.00	98.22%	36	EUR	98 257	0.28
TMO 0.125% 03/2025	XS2058556296	100 000.00	97.17%	52	EUR	97 222	0.28
BAC 1.379% 02/2025	XS1560863802	100 000.00	99.51%	661	EUR	100 166	0.29



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA MODERADO
Composição da Carteira em: 2022-07-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
DLR 2.5% 01/2026	XS1891174341	100 000.00	99.58%	1 349	EUR	100 924	0.29
C 2.125% 09/2026	XS1107727007	100 000.00	99.78%	1 892	EUR	101 676	0.29
INTNED 3% 04/2028	XS1590823859	100 000.00	99.99%	921	EUR	100 910	0.29
NIBCAP 0.875% 07/25	XS2023631489	100 000.00	94.67%	58	EUR	94 723	0.27
RELLN 0% 03/2024	XS2126161681	100 000.00	97.93%		EUR	97 925	0.28
REPSM 0.125% 10/2024	XS2241090088	100 000.00	97.69%	103	EUR	97 791	0.28
ANNGR 1.5% 06/2026	DE000A182VT2	100 000.00	95.70%	214	EUR	95 910	0.28
SIEGR 0.375% 06/26	XS2182054887	100 000.00	96.52%	59	EUR	96 582	0.28
INTNED 1.25% 02/27	XS2443920249	100 000.00	96.17%	568	EUR	96 741	0.28
BMW 0.375% 01/27	XS2102357014	100 000.00	95.75%	204	EUR	95 955	0.28
CARLB 2.5% 05/2024	XS1071713470	100 000.00	101.68%	445	EUR	102 129	0.29
NYKRE 0.75% 01/2027	DK0009526998	100 000.00	92.86%	397	EUR	93 258	0.27
SPOLNO 0.25% 09/2024	XS2057872595	100 000.00	97.27%	209	EUR	97 481	0.28
NESVFH 0.75% 03/2028	FI4000496286	100 000.00	91.23%	265	EUR	91 492	0.26
DLTAS 2008-1 A	XS0390756285	13 990.66	99.86%	1	EUR	13 972	0.04
GLENLN 1.875% 09/23	XS1489184900	100 000.00	99.89%	1 654	EUR	101 548	0.29
SUMIBK 1.413 06/27	XS1621087516	100 000.00	96.15%	186	EUR	96 331	0.28
TACHEM 2.25% 11/2026	XS1843449122	100 000.00	102.67%	1 560	EUR	104 234	0.30
RY 0.125% 07/2024	XS2031862076	100 000.00	97.68%	3	EUR	97 686	0.28
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO						9 531 769	27.42
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO - GOVERNOS						6 650 325	19.13
BLUEBAY INV GR EUR G	LU0549539178	8 351.53	168.75		EUR	1 409 320	4.05
JPM F-EU GVT-1€	LU0355584201	11 832.69	120.40		EUR	1 424 680	4.10
BGF-EMKLCB-12€	LU1559746307	32 891.52	21.69		EUR	713 417	2.05
XUS TREASURY €	LU1399300455	29 656.00	104.63		EUR	3 102 907	8.92
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO - CORPORATE						2 881 444	8.29
VONTOBEL EUR CRP MID	LU0278087860	1 377.39	160.29		EUR	220 781	0.64
EAST-US CB-CE HG	LU1245751505	91 054.09	10.49		EUR	954 975	2.75
PGIS-CR BD-IN€HA	IE00BDBBRD46	98 064.90	9.76		EUR	957 113	2.75
LORD ABB-HIG YLD-€IH	IE00BJ7BPF87	25 933.71	12.22		EUR	316 910	0.91
BGF-EUR CORP-I2	LU1373033965	20 210.27	10.68		EUR	215 846	0.62
ESIF-M&G EC-FA€	LU2101367030	2 193.50	98.39		EUR	215 818	0.62
MATÉRIAS PRIMAS						341 550	0.98
GS-GSQ MOD-C	LU0397156430	26 026.83	13.39		USD	341 550	0.98
ALTERNATIVOS						312 192	0.90
CAIXA PRIVATE EQUITY	PTYME4LE0005	16 936.00	6.35		EUR	107 622	0.31
CAIXA INFRAESTRUTURA	PTYME7LE0002	24 958.00	8.20		EUR	204 571	0.59
IMOBILIÁRIO						5 001 376	14.38
IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO						5 001 376	14.38
CXG IMOBILIARIO	PTYMESHE0009	182 714.00	4.66		EUR	851 045	2.45



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA MODERADO
Composição da Carteira em: 2022-07-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

IMOBILIÁRIO > IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
FUNDIESTAMO I	PTGFIBIM0004	58.00	1 208.10		EUR	70 070	0.20
Fundimo	PTYCXTHM0007	499 530.00	8.17		EUR	4 080 261	11.74
LIQUIDEZ						2 357 833	6.78
TOTAL						34 768 159	100.00

Saldos de Unidades de Participação

	Peso (%)	Valor (EUR)
Valor (EUR)	100.00	34 768 158.980000
Quantidade		5 329 088.761469
Cotação 2022-08-01 (EUR)		6.524200

Câmbios

CHF / EUR	1.030291
DKK / EUR	0.134311
EUR / EUR	1.000000
GBP / EUR	1.194130
NOK / EUR	0.101302
SEK / EUR	0.096195
USD / EUR	0.980200