



# CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA  
FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA  
Composição da Carteira em: 2022-01-31

## COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
<b>AÇÕES</b>						<b>12 633 992</b>	<b>10.94</b>
AÇÕES EUA						0	0.00
AÇÕES EUA - INV. DIRETO						0	0.00
ESH2 S&P500 03/22	91004070051	3.00	4 465.25		USD	0	0.00
AÇÕES ÁSIA						1 113 659	0.96
AÇÕES ÁSIA - INV. INDIRETO						1 113 659	0.96
X MSCI JAPAN EUR	LU0659580079	45 790.00	24.32		EUR	1 113 659	0.96
AÇÕES EUROPEIAS						11 520 334	9.98
AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO						3 884 292	3.36
EDP Renováveis	ES0127797019	1 782.00	18.62		EUR	33 181	0.03
VGH2 EUR EUX 03/22	DE000C47BQN9	28.00	4 176.50		EUR	0	0.00
BMW	DE0005190003	335.00	92.95		EUR	31 138	0.03
SIEMENS	DE0007236101	1 037.00	139.88		EUR	145 056	0.13
ALLIANZ	DE0008404005	270.00	227.35		EUR	61 385	0.05
BASF	DE000BASF111	946.00	67.52		EUR	63 874	0.06
BAYER AG	DE000BAY0017	1 678.00	53.84		EUR	90 344	0.08
RWE-RHEINISCH WEST..	DE0007037129	438.00	37.31		EUR	16 342	0.01
ADIDAS- SALOMON AG	DE000A1EWWWO	153.00	242.25		EUR	37 064	0.03
SAP SE	DE0007164600	727.00	110.40		EUR	80 261	0.07
DEUTSCHE TELEKOM	DE0005557508	4 662.00	16.67		EUR	77 725	0.07
Mercedes-Benz Grp AG	DE0007100000	1 073.00	69.93		EUR	75 035	0.06
INFINEON TECHNOLOGIE	DE0006231004	493.00	36.34		EUR	17 913	0.02
DEUTSCHE POST	DE0005552004	2 050.00	52.99		EUR	108 630	0.09
DEUTSCHE BOERSE AG	DE0005810055	259.00	157.20		EUR	40 715	0.04
VOLKSWAGEN AG-PREF.	DE0007664039	213.00	183.32		EUR	39 047	0.03
FRESENIUS SE&CO KGAA	DE0005785604	639.00	36.56		EUR	23 362	0.02
SIEMENS HEALTHIN	DE000SHL1006	688.00	56.76		EUR	39 051	0.03
DANONE	FR0000120644	767.00	55.25		EUR	42 377	0.04
AXA-UAP	FR0000120628	765.00	27.96		EUR	21 386	0.02
PERNOD RICARD	FR0000120693	355.00	189.00		EUR	67 095	0.06
TotalEnergies SE	FR0000120271	2 342.00	50.22		EUR	117 615	0.10
L OREAL	FR0000120321	355.00	376.85		EUR	133 782	0.12
Kering	FR0000121485	82.00	656.30		EUR	53 817	0.05
BNP	FR0000131104	1 753.00	63.00		EUR	110 439	0.10
AIR LIQUIDE	FR0000120073	646.00	151.38		EUR	97 791	0.08
SCHNEIDER	FR0000121972	400.00	149.36		EUR	59 744	0.05
L.V.M.H.	FR0000121014	307.00	722.60		EUR	221 838	0.19
MICHELIN	FR0000121261	276.00	147.70		EUR	40 765	0.04



# CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA  
FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA  
Composição da Carteira em: 2022-01-31

## COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
SAINT-GOBAIN	FR0000125007	853.00	59.65		EUR	50 881	0.04
SOCIETE GENERALE	FR0000130809	2 256.00	32.69		EUR	73 737	0.06
CAP GEMINI SOGETI	FR0000125338	306.00	197.45		EUR	60 420	0.05
EssilorLuxottica	FR0000121667	274.00	166.82		EUR	45 709	0.04
GLE ENTREP. VINCI	FR0000125486	610.00	96.66		EUR	58 963	0.05
SANOFI SYNHLABO	FR0000120578	976.00	92.75		EUR	90 524	0.08
AIRBUS SE	NL0000235190	729.00	112.12		EUR	81 735	0.07
SAFRAN SA	FR0000073272	177.00	106.62		EUR	18 872	0.02
HERMES INTERNACIONAL	FR0000052292	35.00	1 318.50		EUR	46 148	0.04
TELEPERFORMANCE	FR0000051807	78.00	333.40		EUR	26 005	0.02
RECKITT BENCKISER	GB00B24CGK77	369.00	60.11		GBP	26 585	0.02
OCADO GROUP PLC	GB00B3MBS747	1 134.00	15.04		GBP	20 442	0.02
GLENCORE PLC	JE00B4T3BW64	3 918.00	3.83		GBP	17 986	0.02
AMADEUS HOLDING SA	ES0109067019	780.00	60.54		EUR	47 221	0.04
TELEFONICA	ES0178430E18	9 222.00	4.13		EUR	38 073	0.03
BCO SANTANDER C.HISP	ES0113900J37	6 201.00	3.09		EUR	19 189	0.02
IBERDROLA	ES0144580Y14	6 140.00	10.16		EUR	62 382	0.05
FERROVIAL	ES0118900010	627.00	24.57		EUR	15 405	0.01
INDITEX	ES0148396007	1 672.00	26.74		EUR	44 709	0.04
Siemens Gamesa R	ES0143416115	505.00	19.10		EUR	9 643	0.01
GENERALI ASSUC.	IT0000062072	1 506.00	18.58		EUR	27 981	0.02
UNICREDITO ITALIANO	IT0005239360	6 518.00	13.99		EUR	91 187	0.08
ENI SPA	IT0003132476	1 481.00	13.31		EUR	19 709	0.02
ENEL	IT0003128367	8 341.00	6.78		EUR	56 560	0.05
ESSITY AKTIEBO-B	SE0009922164	847.00	261.90		SEK	21 198	0.02
ING GROEP NV	NL0011821202	7 874.00	13.06		EUR	102 850	0.09
ASML NA	NL0010273215	481.00	594.20		EUR	285 810	0.25
AKZO NOBEL NV NLG20	NL0013267909	208.00	91.56		EUR	19 044	0.02
DSM NV	NL0000009827	112.00	166.05		EUR	18 598	0.02
STELLANTIS NV	NL00150001Q9	4 487.00	16.97		EUR	76 144	0.07
ASR NEDERLAND NV	NL0011872643	889.00	41.19		EUR	36 618	0.03
Prosus NV	NL0013654783	592.00	73.44		EUR	43 476	0.04
Universal Music Grp	NL0015000IY2	1 200.00	21.82		EUR	26 184	0.02
NOKIA A	FI0009000681	10 763.00	5.25		EUR	56 473	0.05
SAMPO OYJ-A SHS	FI0009003305	1 089.00	43.85		EUR	47 753	0.04
ANHEUSER-BUSCH INB	BE0974293251	966.00	55.72		EUR	53 826	0.05
ERST BK DER OEST.SPA	AT0000652011	1 370.00	41.23		EUR	56 485	0.05
CRH ORD	IE0001827041	945.00	44.41		EUR	41 967	0.04
IBERDROLA DIR INC.	ES06445809N8	6 140.00	0.17		EUR	1 028	0.00
AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO						7 636 042	6.61



# CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA  
FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA  
Composição da Carteira em: 2022-01-31

## COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRECTO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
ALLIANZ RCM EUR EQTY	LU0852482198	1 061.01	2 470.47		EUR	2 621 201	2.27
SCHRO-EU EQ-IZE	LU2004793787	51 160.86	53.76		EUR	2 750 382	2.38
EU STEQ-SI/ANPFE	LU1799977381	8 274.29	135.51		EUR	1 121 249	0.97
AB I-EUZ EQ S1€	LU0528104002	32 514.50	35.16		EUR	1 143 210	0.99
<b>OBRIGAÇÕES</b>						<b>75 953 408</b>	<b>65.77</b>
OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO						75 953 408	65.77
OBRIGAÇÕES GOVERNOS						18 056 076	15.63
DBR 1.5% 02/2023	DE0001102309	1 354 000.00	102.25%	19 531	EUR	1 404 010	1.22
DBR 0.5% 08/27	DE0001102424	1 800 000.00	104.10%	4 192	EUR	1 878 046	1.63
DBR 0.25% 02/2029	DE0001102465	1 500 000.00	103.00%	3 606	EUR	1 548 591	1.34
DBR 0% 08/2050	DE0001102481	335 000.00	93.26%		EUR	312 434	0.27
BKO 0% 09/2022	DE0001104818	509 000.00	100.40%		EUR	511 041	0.44
DBR 0% 05/2036	DE0001102549	650 000.00	97.88%		EUR	636 233	0.55
FRTR 4.25% 10/2023	FR0010466938	289 000.00	108.34%	3 331	EUR	316 431	0.27
FRTR 0.25% 11/26	FR0013200813	4 354 000.00	101.63%	2 028	EUR	4 426 911	3.83
FRTR 0.75% 05/2053	FR0014004J31	100 000.00	91.97%	518	EUR	92 484	0.08
SPGB 1.95% 07/2030	ES00000127A2	275 000.00	111.62%	2 733	EUR	309 679	0.27
SPGB 3.45% 07/66	ES00000128E2	439 000.00	146.46%	7 718	EUR	650 673	0.56
SPGB 0.45% 10/22	ES0000012A97	1 647 000.00	100.75%	1 888	EUR	1 661 274	1.44
BTPS 1,7% 09/2051	IT0005425233	800 000.00	91.77%	5 748	EUR	739 924	0.64
RAGB 0% 07/2023	AT0000A1PE50	1 084 000.00	100.79%		EUR	1 092 564	0.95
IRISH 0% 10/22	IE00BDHDPQ37	337 000.00	100.35%		EUR	338 173	0.29
KOREA 0% 09/2025	XS2226969686	200 000.00	99.59%		EUR	199 174	0.17
KFW 0% 04/2024	DE000A2LQSP7	422 000.00	100.79%		EUR	425 325	0.37
CCTS Float 07/2023	IT0005185456	1 300 000.00	100.95%	102	EUR	1 312 439	1.14
EU 0% 07/2026	EU000A3KTGV8	200 000.00	100.34%		EUR	200 670	0.17
<b>OBRIGAÇÕES CRÉDITO</b>						<b>57 897 332</b>	<b>50.13</b>
DAIGR Float 07/24	DE000A2GSCY9	600 000.00	100.73%		EUR	604 398	0.52
PBBGR Float 07/28/23	DE000A2YNV36	1 000 000.00	100.84%	38	EUR	1 008 478	0.87
DB Float 05/2022	DE000DL19TQ2	2 400 000.00	100.17%	1 222	EUR	2 405 350	2.08
ACAFP Float 04/22	XS1598861588	1 500 000.00	100.16%	121	EUR	1 502 446	1.30
SOCGEN Float 05/24	XS1616341829	1 600 000.00	101.33%	745	EUR	1 622 025	1.40
BNP Float 06/24	XS1626933102	1 000 000.00	101.34%	291	EUR	1 013 721	0.88
RENAUL Float 03/2022	FR0013260486	400 000.00	100.04%	45	EUR	400 217	0.35
GFCFP Float 06/22	FR0013266343	500 000.00	100.13%		EUR	500 635	0.43
RENAULT Float 11/24	FR0013292687	1 200 000.00	100.18%	9	EUR	1 202 193	1.04
BNP Float 05/23	XS1823532996	300 000.00	100.65%	33	EUR	301 992	0.26
CAFP Float 09/2023	FR0013446580	1 900 000.00	100.47%	172	EUR	1 909 045	1.65
LLOYDS Float 06/2024	XS1633845158	1 000 000.00	101.47%	232	EUR	1 014 882	0.88
HSBC Float 10/23	XS1681855539	1 500 000.00	100.26%		EUR	1 503 840	1.30



# CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA  
FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA  
Composição da Carteira em: 2022-01-31

## COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
BACR Float 05/2026	XS2342059784	2 000 000.00	101.83%	1 940	EUR	2 038 500	1.77
HSBC Float 09/2026	XS2388490802	2 100 000.00	102.03%	930	EUR	2 143 623	1.86
IBESM Float 02/24	XS1564443759	1 200 000.00	100.73%	251	EUR	1 208 987	1.05
SANTAN Float 03/22	XS1578916261	1 000 000.00	100.12%	512	EUR	1 001 702	0.87
AMSSM Float 03/22	XS1878190757	700 000.00	100.03%		EUR	700 189	0.61
SANTAN Float 03/23	XS1689234570	500 000.00	100.68%	79	EUR	503 489	0.44
ISPIM Float 04/22	XS1599167589	1 000 000.00	100.16%	141	EUR	1 001 711	0.87
BACRED Float 05/22	XS1615501837	1 000 000.00	100.17%	504	EUR	1 002 234	0.87
BAC Float 05/23	XS1602557495	350 000.00	100.16%	184	EUR	350 741	0.30
GS Float 09/23	XS1691349523	800 000.00	100.21%	23	EUR	801 679	0.69
F Float 12/24	XS1729872736	550 000.00	97.96%	123	EUR	538 903	0.47
F Float 12/22	XS1767930826	300 000.00	99.58%		EUR	298 746	0.26
C Float 03/23	XS1795253134	1 650 000.00	100.45%		EUR	1 657 491	1.44
GM Float 03/22	XS1792505197	300 000.00	100.05%		EUR	300 162	0.26
BAC FLOAT 04/24	XS1811433983	1 400 000.00	100.45%	40	EUR	1 406 326	1.22
T Float 09/23	XS1907118464	1 500 000.00	100.94%	677	EUR	1 514 762	1.31
GS Float 04/2023	XS2107332483	500 000.00	100.05%		EUR	500 255	0.43
BAC Float 09/2026	XS2387929834	2 200 000.00	101.52%	1 032	EUR	2 234 494	1.93
CS Float 01/2026	CH0591979635	2 200 000.00	101.13%	401	EUR	2 225 349	1.93
DAIGR Float 05/22	DE000A19HBM3	500 000.00	100.10%		EUR	500 505	0.43
BAYNGR Float 06/22	XS1840614736	1 500 000.00	100.13%		EUR	1 502 010	1.30
INTNED Float 09/23	XS1882544205	600 000.00	101.17%	187	EUR	607 231	0.53
VW Float 11/24	XS1910947941	1 600 000.00	103.37%	3 381	EUR	1 657 333	1.44
ANNGR Float 12/2022	DE000A19X793	1 600 000.00	100.30%		EUR	1 604 848	1.39
NYKRE Float 06/22	DK0009514473	700 000.00	100.13%		EUR	700 896	0.61
NYKRE Flt. 01/24	DK0009520520	300 000.00	100.44%		EUR	301 313	0.26
SBBSS Float 2/2023	XS2293906199	1 300 000.00	100.00%	309	EUR	1 300 322	1.13
SBBSS FLT 02/24	XS2438632874	1 000 000.00	100.07%		EUR	1 000 730	0.87
KBCBB Float 11/22	BE0002281500	1 600 000.00	100.37%		EUR	1 605 904	1.39
ABIBB Float 04/24	BE6301509012	1 600 000.00	100.58%		EUR	1 609 248	1.39
DLTAS 2008-1 A	XS0390756285	202 277.84	99.91%		EUR	202 101	0.17
DHR Float 06/22	XS1637162246	950 000.00	100.15%		EUR	951 416	0.82
DE FLOAT 10/22	XS1692846790	2 100 000.00	100.27%		EUR	2 105 691	1.82
SUMIBK Float 06/22	XS1621087359	1 500 000.00	100.14%		EUR	1 502 145	1.30
TACHEM Float 11/22	XS1843449809	1 600 000.00	100.74%	1 691	EUR	1 613 483	1.40
MUFG Float 05/2023	XS1828132735	1 400 000.00	100.52%		EUR	1 407 336	1.22
CBAAU Float 03/2023	XS1789454326	700 000.00	100.56%		EUR	703 906	0.61
GS Float 07/2022	XS1173867323	600 000.00	100.38%	46	EUR	602 350	0.52
<b>ALTERNATIVOS</b>						<b>909 396</b>	<b>0.79</b>
CAIXA PRIVATE EQUITY	PTYME4LE0005	40 509.00	6.33		EUR	256 438	0.22



# CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA  
FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA  
Composição da Carteira em: 2022-01-31

## COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

### ALTERNATIVOS

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
CAIXA INFRAESTRUTURA	PTYME7LE0002	82 413.00	7.92		EUR	652 958	0.57
<b>IMOBILIÁRIO</b>						<b>17 010 569</b>	<b>14.73</b>
IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO						5 113 700	4.43
REPUBLICA 35- R/C	P50040000002	8.00			EUR	5 113 700	4.43
IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO						11 896 869	10.30
CXG IMOBILIARIO	PTYMESHE0009	710 909.00	4.43		EUR	3 148 829	2.73
Fundimo	PTYCXTHM0007	1 088 472.00	8.04		EUR	8 747 505	7.57
TISHMAN ESOF	14300000004	91 579.00	0.01		EUR	535	0.00
<b>LIQUIDEZ</b>						<b>8 982 777</b>	<b>7.78</b>
<b>TOTAL</b>						<b>115 490 143</b>	<b>100.00</b>

### Saldos de Unidades de Participação

	Peso (%)	Valor (EUR)
Valor (EUR)	100.00	115 490 143.000000
Quantidade		8 314 915.560189
Cotação 2022-02-01 (EUR)		13.889500

### Câmbios

CHF / EUR	0.958598
DKK / EUR	0.134396
EUR / EUR	1.000000
GBP / EUR	1.198567
NOK / EUR	0.100098
SEK / EUR	0.095558
USD / EUR	0.891902