



# CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA  
FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA  
Composição da Carteira em: 2021-07-31

## COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
<b>AÇÕES</b>						<b>14 433 763</b>	<b>12.17</b>
AÇÕES EUA						198	0.00
AÇÕES EUA - INV. DIRETO						0	0.00
ESU1 S&P500 09/21	91004070049	4.00	4 391.25		USD	0	0.00
AÇÕES EUA - INV. INDIRETO						198	0.00
TROWE ROWE PRICE I	LU0133088293	1.00	29.82		USD	25	0.00
MORGAN-US AD-Z\$	LU0360484686	1.00	205.41		USD	173	0.00
AÇÕES EUROPEIAS						13 859 216	11.69
AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO						3 812 269	3.21
EDP Renováveis	ES0127797019	1 782.00	19.80		EUR	35 284	0.03
VGU1 EUR EUX 09/21	DE000C4FMQL5	15.00	4 090.00		EUR	0	0.00
BMW	DE0005190003	747.00	83.88		EUR	62 658	0.05
DEUTSCHE BANK	DE0005140008	5 199.00	10.66		EUR	55 411	0.05
SIEMENS	DE0007236101	1 037.00	131.58		EUR	136 448	0.12
ALLIANZ	DE0008404005	225.00	210.00		EUR	47 250	0.04
BASF	DE000BASF111	910.00	66.22		EUR	60 260	0.05
BAYER AG	DE000BAY0017	1 888.00	50.29		EUR	94 948	0.08
RWE-RHEINISCH WEST..	DE0007037129	438.00	30.01		EUR	13 144	0.01
ADIDAS- SALOMON AG	DE000A1EWWW0	153.00	306.10		EUR	46 833	0.04
SAP SE	DE0007164600	663.00	120.84		EUR	80 117	0.07
DEUTSCHE TELEKOM	DE0005557508	4 801.00	17.51		EUR	84 046	0.07
DAIMLER CHRYSLER	DE0007100000	528.00	75.28		EUR	39 748	0.03
INFINEON TECHNOLOGIE	DE0006231004	401.00	32.14		EUR	12 886	0.01
DEUTSCHE POST	DE0005552004	2 050.00	57.11		EUR	117 076	0.10
VOLKSWAGEN AG-PREF.	DE0007664039	162.00	205.50		EUR	33 291	0.03
FRESENIUS SE&CO KGAA	DE0005785604	753.00	44.32		EUR	33 373	0.03
SIEMENS HEALTHIN	DE000SHL1006	727.00	55.68		EUR	40 479	0.03
Siemens Energy AG	DE000ENER6Y0	519.00	22.94		EUR	11 906	0.01
DANONE	FR0000120644	767.00	62.06		EUR	47 600	0.04
AXA-UAP	FR0000120628	939.00	21.88		EUR	20 545	0.02
PERNOD RICARD	FR0000120693	355.00	186.10		EUR	66 066	0.06
TotalEnergies SE	FR0000120271	2 230.00	36.70		EUR	81 841	0.07
L OREAL	FR0000120321	355.00	385.90		EUR	136 995	0.12
Kering	FR0000121485	82.00	756.20		EUR	62 008	0.05
BNP	FR0000131104	1 766.00	51.45		EUR	90 861	0.08
AIR LIQUIDE	FR0000120073	453.00	146.58		EUR	66 401	0.06
SCHNEIDER	FR0000121972	293.00	141.30		EUR	41 401	0.03
L.V.M.H.	FR0000121014	317.00	673.90		EUR	213 626	0.18



# CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA  
FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA  
Composição da Carteira em: 2021-07-31

## COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
MICHELIN	FR0000121261	173.00	137.70		EUR	23 822	0.02
SAINT-GOBAIN	FR0000125007	853.00	60.25		EUR	51 393	0.04
BOUYGUES	FR0000120503	572.00	32.49		EUR	18 584	0.02
EssilorLuxottica	FR0000121667	285.00	159.16		EUR	45 361	0.04
GLE ENTREP. VINCI	FR0000125486	610.00	89.21		EUR	54 418	0.05
ST MICROELECTRON	NL0000226223	1 558.00	34.53		EUR	53 790	0.05
DASSAULT SYSTEMES	FR0014003TT8	1 040.00	46.52		EUR	48 381	0.04
SANOFI SYNHLABO	FR0000120578	1 061.00	86.88		EUR	92 180	0.08
AIRBUS SE	NL0000235190	729.00	115.70		EUR	84 345	0.07
CREDIT AGRICOLE SA	FR0000045072	3 749.00	11.76		EUR	44 088	0.04
ILIAD SA	FR0004035913	204.00	182.05		EUR	37 138	0.03
SAFRAN SA	FR0000073272	177.00	110.30		EUR	19 523	0.02
HERMES INTERNACIONAL	FR0000052292	30.00	1 289.00		EUR	38 670	0.03
TELEPERFORMANCE	FR0000051807	78.00	355.60		EUR	27 737	0.02
RECKITT BENCKISER	GB00B24CGK77	369.00	55.23		GBP	23 898	0.02
ANGLO AMERICAN PLC	GB00B1XZS820	826.00	31.91		GBP	30 903	0.03
OCADO GROUP PLC	GB00B3MBS747	1 134.00	18.55		GBP	24 667	0.02
TELEFONICA	ES0178430E18	3 973.00	3.87		EUR	15 360	0.01
BCO SANTANDER C.HISP	ES0113900J37	24 722.00	3.09		EUR	76 329	0.06
IBERDROLA	ES0144580Y14	6 140.00	10.16		EUR	62 382	0.05
FERROVIAL	ES0118900010	627.00	25.00		EUR	15 675	0.01
INDITEX	ES0148396007	1 672.00	28.59		EUR	47 802	0.04
TELECOM ITALIA	IT0003497168	46 811.00	0.37		EUR	17 362	0.01
UNICREDITO ITALIANO	IT0005239360	4 902.00	10.11		EUR	49 549	0.04
ENI SPA	IT0003132476	1 345.00	10.02		EUR	13 482	0.01
ENEL	IT0003128367	8 341.00	7.78		EUR	64 893	0.05
ESSITY AKTIEBO-B	SE0009922164	847.00	281.50		SEK	23 388	0.02
ZURICH ALLIED AG	CH0011075394	64.00	365.80		CHF	21 779	0.02
ASML NA	NL0010273215	514.00	639.00		EUR	328 446	0.28
AKZO NOBEL NV NLG20	NL0013267909	408.00	104.10		EUR	42 473	0.04
DSM NV	NL0000009827	278.00	169.95		EUR	47 246	0.04
STELLANTIS NV	NL00150001Q9	4 487.00	16.19		EUR	72 645	0.06
Prosus NV	NL0013654783	592.00	74.85		EUR	44 311	0.04
Adyen NV	NL0012969182	10.00	2 289.50		EUR	22 895	0.02
SAMPO OYJ-A SHS	FI0009003305	1 645.00	40.62		EUR	66 820	0.06
Neste Oyj	FI0009013296	358.00	51.82		EUR	18 552	0.02
KBC BANKVERZEKERING	BE0003565737	970.00	67.90		EUR	65 863	0.06
ANHEUSER-BUSCH INB	BE0974293251	966.00	53.40		EUR	51 584	0.04
ERST BK DER OEST.SPA	AT0000652011	1 766.00	32.71		EUR	57 766	0.05
CRH ORD	IE0001827041	811.00	42.25		EUR	34 265	0.03



# CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA  
FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA  
Composição da Carteira em: 2021-07-31

## COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRECTO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
<b>AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRECTO</b>						<b>10 046 947</b>	<b>8.47</b>
ALLIANZ RCM EUR EQTY	LU0852482198	1 365.96	2 741.81		EUR	3 745 200	3.16
AB SCV I-EUZ EQ I	LU0528103707	92 079.81	33.58		EUR	3 092 040	2.61
SCHRO-EU EQ-IZE	LU2004793787	58 003.96	55.34		EUR	3 209 707	2.71
<b>AÇÕES EMERGENTES</b>						<b>574 349</b>	<b>0.48</b>
<b>AÇÕES EMERGENTES - INV. INDIRECTO</b>						<b>574 349</b>	<b>0.48</b>
ISHARES MSCI EMER.MK	US4642872349	13 170.00	51.74		USD	574 349	0.48
<b>OBRIGAÇÕES</b>						<b>80 704 243</b>	<b>68.05</b>
<b>OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO</b>						<b>77 096 063</b>	<b>65.01</b>
<b>OBRIGAÇÕES GOVERNOS</b>						<b>18 606 127</b>	<b>15.69</b>
DBR 1.5% 02/2023	DE0001102309	54 000.00	103.53%	371	EUR	56 276	0.05
DBR 1.25% 08/48	DE0001102432	547 000.00	134.36%	6 575	EUR	741 524	0.63
DBR 0% 08/2050	DE0001102481	315 000.00	99.42%		EUR	313 182	0.26
BKO 0% 09/2022	DE0001104818	709 000.00	100.85%		EUR	715 034	0.60
FRTR 4.25% 10/2023	FR0010466938	289 000.00	111.20%	9 422	EUR	330 802	0.28
FRTR 3% 04/2022	FR0011196856	1 633 000.00	102.68%	13 153	EUR	1 689 918	1.42
FRTR 0.25% 11/26	FR0013200813	4 354 000.00	104.51%	7 426	EUR	4 557 922	3.84
SPGB 1.95% 07/2030	ES00000127A2	275 000.00	116.74%	29	EUR	321 073	0.27
SPGB 3.45% 07/66	ES00000128E2	439 000.00	163.22%	83	EUR	716 632	0.60
SPGB 0.45% 10/22	ES0000012A97	1 647 000.00	101.37%	5 564	EUR	1 675 062	1.41
BTPS 4% 2/2037	IT0003934657	269 000.00	141.32%	5 380	EUR	385 533	0.33
BTPS 2% 12/2025	IT0005127086	1 881 000.00	109.19%	6 270	EUR	2 060 172	1.74
BTPS 3.45% 03/48	IT0005273013	1 018 000.00	141.24%	14 602	EUR	1 452 446	1.22
RAGB 0% 07/2023	AT0000A1PE50	1 084 000.00	101.40%		EUR	1 099 165	0.93
IRISH 0% 10/22	IE00BDHDPQ37	337 000.00	100.75%		EUR	339 514	0.29
KOREA 0% 09/2025	XS2226969686	200 000.00	100.91%		EUR	201 812	0.17
KFW 0% 04/2024	DE000A2LQSP7	422 000.00	101.69%		EUR	429 119	0.36
CCTS Float 07/2023	IT0005185456	1 300 000.00	101.16%	115	EUR	1 315 247	1.11
EU 0% 07/2026	EU000A3KTGV8	200 000.00	102.85%		EUR	205 696	0.17
<b>OBRIGAÇÕES CRÉDITO</b>						<b>58 489 935</b>	<b>49.32</b>
DAIGR Float 07/24	DE000A2GSCY9	600 000.00	100.66%		EUR	603 960	0.51
VW Float 12/21	XS1830992563	1 700 000.00	100.18%	393	EUR	1 703 504	1.44
PBBGR Float 07/28/23	DE000A2YINV36	1 000 000.00	100.95%	40	EUR	1 009 560	0.85
DB Float 05/2022	DE000DL19TQ2	2 400 000.00	100.39%	1 312	EUR	2 410 576	2.03
ACAFP Float 04/22	XS1598861588	1 500 000.00	100.52%	126	EUR	1 507 956	1.27
SOCGEN Float 05/24	XS1616341829	1 600 000.00	101.48%	782	EUR	1 624 526	1.37
BNP Float 06/24	XS1626933102	1 000 000.00	101.42%	318	EUR	1 014 508	0.86
RENAUL Float 03/2022	FR0013260486	400 000.00	100.25%	67	EUR	401 067	0.34
GFCFP Float 06/22	FR0013266343	500 000.00	100.28%		EUR	501 405	0.42
RENAULT Float 11/24	FR0013292687	400 000.00	100.32%	35	EUR	401 315	0.34



# CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA  
FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA  
Composição da Carteira em: 2021-07-31

## COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
BNP Float 05/23	XS1823532996	300 000.00	100.85%	43	EUR	302 587	0.26
CAFP Float 09/2023	FR0013446580	1 900 000.00	100.57%	266	EUR	1 911 115	1.61
HSBC Float 09/22	XS1586214956	100 000.00	100.09%	15	EUR	100 106	0.08
LLOYDS Float 06/2024	XS1633845158	1 000 000.00	101.40%	270	EUR	1 014 240	0.86
HSBC Float 10/23	XS1681855539	1 500 000.00	100.39%		EUR	1 505 850	1.27
CCE FLOAT 11/21	XS1717567587	800 000.00	100.09%		EUR	800 736	0.68
RBS Float 09/21	XS1884702207	1 200 000.00	100.13%	410	EUR	1 201 922	1.01
BACR Float 05/2026	XS2342059784	1 600 000.00	102.04%	1 681	EUR	1 634 305	1.38
IBESM Float 02/24	XS1564443759	1 200 000.00	100.75%	285	EUR	1 209 309	1.02
SANTAN Float 03/22	XS1578916261	1 000 000.00	100.59%	543	EUR	1 006 423	0.85
BBVASM Float 04/22	XS1594368539	1 000 000.00	100.38%	30	EUR	1 003 820	0.85
AMSSM Float 03/22	XS1878190757	700 000.00	100.00%		EUR	700 007	0.59
SANTAN Float 03/23	XS1689234570	500 000.00	100.93%	100	EUR	504 735	0.43
ISPIM Float 04/22	XS1599167589	1 000 000.00	100.58%	145	EUR	1 005 935	0.85
BACRED Float 05/22	XS1615501837	1 000 000.00	100.44%	523	EUR	1 004 943	0.85
WFC Float 01/22	XS1558022866	1 400 000.00	100.22%		EUR	1 403 066	1.18
BAC Float 05/23	XS1602557495	150 000.00	100.46%	91	EUR	150 776	0.13
MS Float 11/22	XS1603892065	1 200 000.00	100.16%	465	EUR	1 202 421	1.01
BATSLN Float 08/21	XS1664643746	500 000.00	100.01%		EUR	500 070	0.42
GS Float 09/23	XS1691349523	800 000.00	100.27%	62	EUR	802 254	0.68
F Float 12/21	XS1729872652	1 000 000.00	99.85%		EUR	998 500	0.84
F Float 12/24	XS1729872736	550 000.00	97.43%	146	EUR	535 995	0.45
F Float 12/22	XS1767930826	300 000.00	99.48%		EUR	298 440	0.25
C Float 03/23	XS1795253134	1 650 000.00	100.63%		EUR	1 660 379	1.40
GM Float 03/22	XS1792505197	300 000.00	100.15%	3	EUR	300 450	0.25
BAC FLOAT 04/24	XS1811433983	1 400 000.00	100.66%	35	EUR	1 409 219	1.19
T Float 09/23	XS1907118464	1 500 000.00	101.18%	742	EUR	1 518 472	1.28
GS Float 04/2023	XS2107332483	500 000.00	100.18%	0	EUR	500 875	0.42
UBS Float 09/22	CH0359915425	1 500 000.00	100.08%	268	EUR	1 501 438	1.27
CS Float 01/2026	CH0591979635	500 000.00	100.95%	101	EUR	504 826	0.43
DAIGR Float 05/22	DE000A19HBM3	500 000.00	100.26%		EUR	501 285	0.42
BAYNGR Float 06/22	XS1840614736	1 500 000.00	100.26%	17	EUR	1 503 857	1.27
INTNED Float 09/23	XS1882544205	600 000.00	101.50%	210	EUR	609 192	0.51
ANNGR Float 12/2022	DE000A19X793	1 600 000.00	100.38%		EUR	1 606 144	1.35
NYKRE Float 06/22	DK0009514473	700 000.00	100.33%	30	EUR	702 354	0.59
NYKRE Flt. 01/24	DK0009520520	300 000.00	100.52%		EUR	301 555	0.25
SPOLNO Float 09/21	XS1884795375	200 000.00	100.06%		EUR	200 128	0.17
SBBSS Float 2/2023	XS2293906199	1 300 000.00	100.13%	371	EUR	1 302 087	1.10
KBCBB Float 11/22	BE0002281500	1 600 000.00	100.59%	15	EUR	1 609 519	1.36
ABIBB Float 04/24	BE6301509012	1 600 000.00	100.53%		EUR	1 608 432	1.36



# CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA  
FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA  
Composição da Carteira em: 2021-07-31

## COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
DLTAS 2008-1 A	XS0390756285	267 717.11	99.88%		EUR	267 396	0.23
DHR Float 06/22	XS1637162246	950 000.00	100.26%		EUR	952 432	0.80
DE FLOAT 10/22	XS1692846790	2 100 000.00	100.44%		EUR	2 109 261	1.78
SUMIBK Float 06/22	XS1621087359	1 500 000.00	100.37%		EUR	1 505 580	1.27
TACHEM Float 11/22	XS1843449809	1 600 000.00	101.17%	1 754	EUR	1 620 474	1.37
MUFG Float 05/2023	XS1828132735	1 400 000.00	100.63%	33	EUR	1 408 811	1.19
CBAAU Float 03/2023	XS1789454326	700 000.00	100.78%		EUR	705 425	0.59
GS Float 07/2022	XS1173867323	600 000.00	100.73%	45	EUR	604 413	0.51
<b>OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO</b>						<b>3 608 181</b>	<b>3.04</b>
<b>OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO - CORPORATE</b>						<b>3 608 181</b>	<b>3.04</b>
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	LU0141799097	45 156.24	40.15		EUR	1 813 023	1.53
ISHARES EUR CORP.BON	IE0032523478	12 658.00	141.82		EUR	1 795 158	1.51
<b>ALTERNATIVOS</b>						<b>865 115</b>	<b>0.73</b>
CAIXA PRIVATE EQUITY	PTYME4LE0005	40 509.00	6.10		EUR	247 166	0.21
CAIXA INFRAESTRUTURA	PTYME7LE0002	82 413.00	7.50		EUR	617 949	0.52
<b>IMOBILIÁRIO</b>						<b>16 469 717</b>	<b>13.89</b>
<b>IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO</b>						<b>5 000 600</b>	<b>4.22</b>
REPUBLICA 35- R/C	P50040000002	8.00			EUR	5 000 600	4.22
<b>IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO</b>						<b>11 469 117</b>	<b>9.67</b>
CXG IMOBILIARIO	PTYMESHE0009	710 909.00	4.13		EUR	2 932 713	2.47
Fundimo	PTYCXTHM0007	1 074 997.00	7.94		EUR	8 535 261	7.20
TISHMAN ESOF	14300000004	91 579.00	0.01		EUR	1 143	0.00
<b>LIQUIDEZ</b>						<b>6 121 580</b>	<b>5.16</b>
<b>TOTAL</b>						<b>118 594 418</b>	<b>100.00</b>

## Saldos de Unidades de Participação

	Peso (%)	Valor (EUR)
Valor (EUR)	100.00	118 594 418.240000
Quantidade		8 469 744.755159
Cotação 2021-08-01 (EUR)		14.002100



# CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA  
FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA  
Composição da Carteira em: 2021-07-31

## Câmbios

CHF / EUR	0.930293
DKK / EUR	0.134432
EUR / EUR	1.000000
GBP / EUR	1.172635
NOK / EUR	0.095494
SEK / EUR	0.098090
USD / EUR	0.842957