

CGD PENSÕES - SGFP,SA
 AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
 FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em: 2021-12-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
AÇÕES						13 462 673	11.51
AÇÕES EUA						0	0.00
AÇÕES EUA - INV. DIRETO						0	0.00
ESH2 S&P500 03/22	91004070051	3.00	4 762.00		USD	0	0.00
AÇÕES ÁSIA						1 178 955	1.01
AÇÕES ÁSIA - INV. INDIRETO						1 178 955	1.01
X MSCI JAPAN EUR	LU0659580079	45 790.00	25.75		EUR	1 178 955	1.01
AÇÕES EUROPEIAS						12 283 718	10.50
AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO						3 996 508	3.42
EDP Renováveis	ES0127797019	1 782.00	21.90		EUR	39 026	0.03
VGH2 EUR EUX 03/22	DE000C47BQN9	28.00	4 287.50		EUR	0	0.00
BMW	DE0005190003	335.00	88.49		EUR	29 644	0.03
SIEMENS	DE0007236101	1 037.00	152.68		EUR	158 329	0.14
ALLIANZ	DE0008404005	270.00	207.65		EUR	56 066	0.05
BASF	DE000BASF111	816.00	61.78		EUR	50 412	0.04
BAYER AG	DE000BAY0017	1 678.00	47.00		EUR	78 866	0.07
RWE-RHEINISCH WEST..	DE0007037129	438.00	35.72		EUR	15 645	0.01
ADIDAS- SALOMON AG	DE000A1EWWWO	153.00	253.20		EUR	38 740	0.03
SAP SE	DE0007164600	727.00	124.90		EUR	90 802	0.08
DEUTSCHE TELEKOM	DE0005557508	4 662.00	16.30		EUR	75 991	0.06
DAIMLER CHRYSLER	DE0007100000	1 073.00	67.59		EUR	72 524	0.06
INFINEON TECHNOLOGIE	DE0006231004	493.00	40.76		EUR	20 095	0.02
DEUTSCHE POST	DE0005552004	2 050.00	56.54		EUR	115 907	0.10
DEUTSCHE BOERSE AG	DE0005810055	259.00	147.10		EUR	38 099	0.03
VOLKSWAGEN AG-PREF.	DE0007664039	213.00	177.48		EUR	37 803	0.03
FRESENIUS SE&CO KGAA	DE0005785604	639.00	35.40		EUR	22 621	0.02
SIEMENS HEALTHIN	DE000SHL1006	688.00	65.82		EUR	45 284	0.04
DANONE	FR0000120644	767.00	54.59		EUR	41 871	0.04
AXA-UAP	FR0000120628	765.00	26.19		EUR	20 032	0.02
PERNOD RICARD	FR0000120693	355.00	211.50		EUR	75 083	0.06
TotalEnergies SE	FR0000120271	1 771.00	44.63		EUR	79 040	0.07
L OREAL	FR0000120321	355.00	416.95		EUR	148 017	0.13
Kering	FR0000121485	82.00	706.90		EUR	57 966	0.05
BNP	FR0000131104	1 753.00	60.77		EUR	106 530	0.09
AIR LIQUIDE	FR0000120073	568.00	153.32		EUR	87 086	0.07
SCHNEIDER	FR0000121972	400.00	172.46		EUR	68 984	0.06
L.V.M.H.	FR0000121014	307.00	727.00		EUR	223 189	0.19
MICHELIN	FR0000121261	276.00	144.15		EUR	39 785	0.03



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
 AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
 FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em: 2021-12-31

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	61.87		EUR	52 775	0.05
SOCIETE GENERALE	FR0000130809	2 256.00	30.21		EUR	68 142	0.06
CAP GEMINI SOGETI	FR0000125338	306.00	215.50		EUR	65 943	0.06
EssilorLuxottica	FR0000121667	274.00	187.24		EUR	51 304	0.04
GLE ENTREP. VINCI	FR0000125486	610.00	92.91		EUR	56 675	0.05
SANOFI SYNHLABO	FR0000120578	976.00	88.58		EUR	86 454	0.07
AIRBUS SE	NL0000235190	729.00	112.36		EUR	81 910	0.07
SAFRAN SA	FR0000073272	177.00	107.66		EUR	19 056	0.02
HERMES INTERNACIONAL	FR0000052292	35.00	1 536.00		EUR	53 760	0.05
TELEPERFORMANCE	FR0000051807	78.00	392.00		EUR	30 576	0.03
RECKITT BENCKISER	GB00B24CGK77	369.00	63.42		GBP	27 851	0.02
ANGLO AMERICAN PLC	GB00B1XZS820	605.00	30.16		GBP	21 716	0.02
OCADO GROUP PLC	GB00B3MBS747	1 134.00	16.78		GBP	22 646	0.02
AMADEUS HOLDING SA	ES0109067019	780.00	59.64		EUR	46 519	0.04
TELEFONICA	ES0178430E18	9 222.00	3.85		EUR	35 523	0.03
BCO SANTANDER C.HISP	ES0113900J37	6 201.00	2.94		EUR	18 234	0.02
IBERDROLA	ES0144580Y14	6 140.00	10.41		EUR	63 917	0.05
FERROVIAL	ES0118900010	627.00	27.56		EUR	17 280	0.01
INDITEX	ES0148396007	1 672.00	28.53		EUR	47 702	0.04
Siemens Gamesa R	ES0143416115	505.00	21.07		EUR	10 640	0.01
GENERALI ASSUC.	IT0000062072	1 506.00	18.63		EUR	28 057	0.02
UNICREDITO ITALIANO	IT0005239360	6 518.00	13.54		EUR	88 280	0.08
ENI SPA	IT0003132476	864.00	12.22		EUR	10 558	0.01
ENEL	IT0003128367	8 341.00	7.05		EUR	58 771	0.05
ESSITY AKTIEBO-B	SE0009922164	847.00	295.40		SEK	24 323	0.02
ING GROEP NV	NL0011821202	7 874.00	12.24		EUR	96 394	0.08
ASML NA	NL0010273215	481.00	706.70		EUR	339 923	0.29
AKZO NOBEL NV NLG20	NL0013267909	308.00	96.50		EUR	29 722	0.03
DSM NV	NL0000009827	278.00	198.00		EUR	55 044	0.05
STELLANTIS NV	NL00150001Q9	4 487.00	16.69		EUR	74 870	0.06
ASR NEDERLAND NV	NL0011872643	889.00	40.50		EUR	36 005	0.03
Prosus NV	NL0013654783	592.00	73.53		EUR	43 530	0.04
Universal Music Grp	NL0015000IY2	1 200.00	24.78		EUR	29 736	0.03
NOKIA A	FI0009000681	10 763.00	5.57		EUR	59 993	0.05
SAMPO OYJ-A SHS	FI0009003305	1 089.00	44.06		EUR	47 981	0.04
Neste Oyj	FI0009013296	358.00	43.36		EUR	15 523	0.01
ANHEUSER-BUSCH INB	BE0974293251	966.00	53.17		EUR	51 362	0.04
ERST BK DER OEST.SPA	AT0000652011	1 370.00	41.35		EUR	56 650	0.05
CRH ORD	IE0001827041	811.00	46.52		EUR	37 728	0.03
AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO						8 287 210	7.08

CGD PENSÕES - SGFP,SA
 AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
 FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em: 2021-12-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
ALLIANZ RCM EUR EQTY	LU0852482198	1 061.01	2 811.49		EUR	2 983 027	2.55
SCHRO-EU EQ-IZE	LU2004793787	51 160.86	57.15		EUR	2 923 756	2.50
EU STEQ-SI/ANPFE	LU1799977381	8 274.29	144.81		EUR	1 198 200	1.02
AB I-EUZ EQ S1€	LU0528104002	32 514.50	36.36		EUR	1 182 227	1.01
OBRIGAÇÕES						75 497 933	64.54
OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO						75 497 933	64.54
OBRIGAÇÕES GOVERNOS						18 200 432	15.56
DBR 1.5% 02/2023	DE0001102309	1 354 000.00	102.46%	17 806	EUR	1 405 155	1.20
DBR 0.5% 08/27	DE0001102424	1 800 000.00	105.25%	3 427	EUR	1 897 927	1.62
DBR 0% 08/2050	DE0001102481	335 000.00	95.13%		EUR	318 682	0.27
BKO 0% 09/2022	DE0001104818	509 000.00	100.46%		EUR	511 346	0.44
DBR 0% 05/2036	DE0001102549	620 000.00	99.62%		EUR	617 663	0.53
FRTR 4.25% 10/2023	FR0010466938	289 000.00	108.88%	2 288	EUR	316 957	0.27
FRTR 3% 04/2022	FR0011196856	1 633 000.00	101.11%	33 689	EUR	1 684 799	1.44
FRTR 0.25% 11/26	FR0013200813	4 354 000.00	102.75%	1 103	EUR	4 474 621	3.83
SPGB 1.95% 07/2030	ES00000127A2	275 000.00	113.33%	2 277	EUR	313 921	0.27
SPGB 3.45% 07/66	ES00000128E2	439 000.00	150.33%	6 432	EUR	666 389	0.57
SPGB 0.45% 10/22	ES0000012A97	1 647 000.00	100.94%	1 259	EUR	1 663 807	1.42
BTPS 1,7% 09/2051	IT0005425233	800 000.00	93.65%	4 583	EUR	753 815	0.64
RAGB 0% 07/2023	AT0000A1PE50	1 084 000.00	100.89%		EUR	1 093 637	0.93
IRISH 0% 10/22	IE00BDHDPQ37	337 000.00	100.43%		EUR	338 449	0.29
KOREA 0% 09/2025	XS2226969686	200 000.00	100.30%		EUR	200 596	0.17
KFW 0% 04/2024	DE000A2LQSP7	422 000.00	101.20%		EUR	427 056	0.37
CCTS Float 07/2023	IT0005185456	1 300 000.00	100.89%	1 148	EUR	1 312 718	1.12
EU 0% 07/2026	EU000A3KTGV8	200 000.00	101.45%		EUR	202 894	0.17
OBRIGAÇÕES CRÉDITO						57 297 501	48.98
DAIGR Float 07/24	DE000A2GSCY9	600 000.00	100.78%		EUR	604 650	0.52
PBBGR Float 07/28/23	DE000A2YNV36	1 000 000.00	100.87%	632	EUR	1 009 302	0.86
DB Float 05/2022	DE000DL19TQ2	2 400 000.00	100.21%	730	EUR	2 405 698	2.06
ACAFP Float 04/22	XS1598861588	1 500 000.00	100.21%	767	EUR	1 503 962	1.29
SOCGEN Float 05/24	XS1616341829	1 600 000.00	101.27%	420	EUR	1 620 676	1.39
BNP Float 06/24	XS1626933102	1 000 000.00	101.32%	130	EUR	1 013 340	0.87
RENAUL Float 03/2022	FR0013260486	400 000.00	100.08%	16	EUR	400 316	0.34
GFCFP Float 06/22	FR0013266343	500 000.00	100.15%		EUR	500 740	0.43
RENAULT Float 11/24	FR0013292687	1 200 000.00	100.20%	6	EUR	1 202 358	1.03
BNP Float 05/23	XS1823532996	300 000.00	100.67%	19	EUR	302 023	0.26
CAFP Float 09/2023	FR0013446580	1 900 000.00	100.55%	65	EUR	1 910 591	1.63
LLOYDS Float 06/2024	XS1633845158	1 000 000.00	101.45%	61	EUR	1 014 541	0.87
HSBC Float 10/23	XS1681855539	1 500 000.00	100.29%		EUR	1 504 335	1.29
BACR Float 05/2026	XS2342059784	2 000 000.00	101.94%	1 197	EUR	2 039 997	1.74



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em: 2021-12-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
HSBC Float 09/2026	XS2388490802	2 100 000.00	102.15%	191	EUR	2 145 341	1.83
IBESM Float 02/24	XS1564443759	1 200 000.00	100.74%	141	EUR	1 209 033	1.03
SANTAN Float 03/22	XS1578916261	1 000 000.00	100.20%	134	EUR	1 002 104	0.86
AMSSM Float 03/22	XS1878190757	700 000.00	100.00%		EUR	700 014	0.60
SANTAN Float 03/23	XS1689234570	500 000.00	100.69%	9	EUR	503 439	0.43
ISPIM Float 04/22	XS1599167589	1 000 000.00	100.23%	826	EUR	1 003 116	0.86
BACRED Float 05/22	XS1615501837	1 000 000.00	100.22%	296	EUR	1 002 446	0.86
WFC Float 01/22	XS1558022866	1 400 000.00	100.03%		EUR	1 400 476	1.20
BAC Float 05/23	XS1602557495	350 000.00	100.21%	120	EUR	350 859	0.30
GS Float 09/23	XS1691349523	800 000.00	100.20%	2	EUR	801 610	0.69
F Float 12/24	XS1729872736	550 000.00	98.45%	62	EUR	541 515	0.46
F Float 12/22	XS1767930826	300 000.00	99.56%		EUR	298 674	0.26
C Float 03/23	XS1795253134	1 650 000.00	100.50%		EUR	1 658 250	1.42
GM Float 03/22	XS1792505197	300 000.00	100.05%		EUR	300 141	0.26
BAC FLOAT 04/24	XS1811433983	1 400 000.00	100.51%	402	EUR	1 407 514	1.20
T Float 09/23	XS1907118464	1 500 000.00	100.98%	309	EUR	1 515 054	1.30
GS Float 04/2023	XS2107332483	500 000.00	100.06%	2	EUR	500 277	0.43
BAC Float 09/2026	XS2387929834	2 200 000.00	101.68%	252	EUR	2 237 124	1.91
CS Float 01/2026	CH0591979635	2 200 000.00	101.21%	2 058	EUR	2 228 766	1.91
DAIGR Float 05/22	DE000A19HBM3	500 000.00	100.14%		EUR	500 705	0.43
BAYNGR Float 06/22	XS1840614736	1 500 000.00	100.17%		EUR	1 502 595	1.28
INTNED Float 09/23	XS1882544205	600 000.00	101.19%	52	EUR	607 216	0.52
VW Float 11/24	XS1910947941	600 000.00	103.48%	757	EUR	621 607	0.53
ANNGR Float 12/2022	DE000A19X793	1 600 000.00	100.31%		EUR	1 604 944	1.37
NYKRE Float 06/22	DK0009514473	700 000.00	100.16%		EUR	701 148	0.60
NYKRE Flt. 01/24	DK0009520520	300 000.00	100.54%		EUR	301 616	0.26
SBBBSS Float 2/2023	XS2293906199	1 300 000.00	100.02%	205	EUR	1 300 452	1.11
KBCBB Float 11/22	BE0002281500	1 600 000.00	100.42%		EUR	1 606 640	1.37
ABIBB Float 04/24	BE6301509012	1 600 000.00	100.61%		EUR	1 609 744	1.38
DLTAS 2008-1 A	XS0390756285	213 183.77	99.97%		EUR	213 116	0.18
DHR Float 06/22	XS1637162246	950 000.00	100.17%		EUR	951 634	0.81
DE FLOAT 10/22	XS1692846790	2 100 000.00	100.29%		EUR	2 106 006	1.80
SUMIBK Float 06/22	XS1621087359	1 500 000.00	100.19%		EUR	1 502 805	1.28
TACHEM Float 11/22	XS1843449809	1 600 000.00	100.81%	953	EUR	1 613 913	1.38
MUFG Float 05/2023	XS1828132735	1 400 000.00	100.55%		EUR	1 407 686	1.20
CBAAU Float 03/2023	XS1789454326	700 000.00	100.60%		EUR	704 214	0.60
GS Float 07/2022	XS1173867323	600 000.00	100.45%	504	EUR	603 180	0.52
ALTERNATIVOS						908 545	0.78
CAIXA PRIVATE EQUITY	PTYME4LE0005	40 509.00	6.29		EUR	254 927	0.22
CAIXA INFRAESTRUTURA	PTYME7LE0002	82 413.00	7.93		EUR	653 618	0.56



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em: 2021-12-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

IMOBILIÁRIO > IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
IMOBILIÁRIO						16 950 545	14.49
IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO						5 113 700	4.37
REPUBLICA 35- R/C	P50040000002	8.00			EUR	5 113 700	4.37
IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO						11 836 845	10.12
CXG IMOBILIARIO	PTYMESHE0009	710 909.00	4.39		EUR	3 117 976	2.67
Fundimo	PTYCXTHM0007	1 088 472.00	8.01		EUR	8 718 334	7.45
TISHMAN ESOF	14300000004	91 579.00	0.01		EUR	535	0.00
LIQUIDEZ						10 159 606	8.68
TOTAL						116 979 301	100.00

Saldos de Unidades de Participação

	Peso (%)	Valor (EUR)
Valor (EUR)	100.00	116 979 301.190000
Quantidade		8 341 468.997859
Cotação 2022-01-01 (EUR)		14.023800

Câmbios

CHF / EUR	0.963828
DKK / EUR	0.134463
EUR / EUR	1.000000
GBP / EUR	1.190122
NOK / EUR	0.099736
SEK / EUR	0.097211
USD / EUR	0.878812