

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

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
AÇÕES						10 903 860	30.75
AÇÕES EUA						0	0.00
AÇÕES EUA - INV. DIRETO						0	0.00
ESH2 S&P500 03/22	91004070051	2.00	4 465.25		USD	0	0.00
AÇÕES ÁSIA						339 035	0.96
AÇÕES ÁSIA - INV. INDIRETO						339 035	0.96
X MSCI JAPAN EUR	LU0659580079	13 940.00	24.32		EUR	339 035	0.96
AÇÕES EUROPEIAS						10 564 826	29.79
AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO						2 495 188	7.04
EDP Renováveis	ES0127797019	1 192.00	18.62		EUR	22 195	0.06
VGH2 EUR EUX 03/22	DE000C47BQN9	13.00	4 176.50		EUR	0	0.00
BMW	DE0005190003	216.00	92.95		EUR	20 077	0.06
SIEMENS	DE0007236101	667.00	139.88		EUR	93 300	0.26
ALLIANZ	DE0008404005	174.00	227.35		EUR	39 559	0.11
BASF	DE000BASF111	608.00	67.52		EUR	41 052	0.12
BAYER AG	DE000BAY0017	1 080.00	53.84		EUR	58 147	0.16
RWE-RHEINISCH WEST..	DE0007037129	282.00	37.31		EUR	10 521	0.03
ADIDAS- SALOMON AG	DE000A1EWWWO	99.00	242.25		EUR	23 983	0.07
SAP SE	DE0007164600	467.00	110.40		EUR	51 557	0.15
DEUTSCHE TELEKOM	DE0005557508	2 996.00	16.67		EUR	49 949	0.14
Mercedes-Benz Grp AG	DE0007100000	692.00	69.93		EUR	48 392	0.14
INFINEON TECHNOLOGIE	DE0006231004	317.00	36.34		EUR	11 518	0.03
DEUTSCHE POST	DE0005552004	1 323.00	52.99		EUR	70 106	0.20
DEUTSCHE BOERSE AG	DE0005810055	166.00	157.20		EUR	26 095	0.07
VOLKSWAGEN AG-PREF.	DE0007664039	137.00	183.32		EUR	25 115	0.07
FRESENIUS SE&CO KGAA	DE0005785604	411.00	36.56		EUR	15 026	0.04
SIEMENS HEALTHIN	DE000SHL1006	443.00	56.76		EUR	25 145	0.07
DANONE	FR0000120644	496.00	55.25		EUR	27 404	0.08
AXA-UAP	FR0000120628	492.00	27.96		EUR	13 754	0.04
PERNOD RICARD	FR0000120693	230.00	189.00		EUR	43 470	0.12
TotalEnergies SE	FR0000120271	1 504.00	50.22		EUR	75 531	0.21
L OREAL	FR0000120321	230.00	376.85		EUR	86 676	0.24
Kering	FR0000121485	53.00	656.30		EUR	34 784	0.10
BNP	FR0000131104	1 126.00	63.00		EUR	70 938	0.20
AIR LIQUIDE	FR0000120073	415.00	151.38		EUR	62 823	0.18
SCHNEIDER	FR0000121972	257.00	149.36		EUR	38 386	0.11
L.V.M.H.	FR0000121014	197.00	722.60		EUR	142 352	0.40
MICHELIN	FR0000121261	177.00	147.70		EUR	26 143	0.07



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA VALOR
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	551.00	59.65		EUR	32 867	0.09
SOCIETE GENERALE	FR0000130809	1 450.00	32.69		EUR	47 393	0.13
CAP GEMINI SOGETI	FR0000125338	196.00	197.45		EUR	38 700	0.11
EssilorLuxottica	FR0000121667	176.00	166.82		EUR	29 360	0.08
GLE ENTREP. VINCI	FR0000125486	395.00	96.66		EUR	38 181	0.11
SANOFI SYNHLABO	FR0000120578	628.00	92.75		EUR	58 247	0.16
AIRBUS SE	NL0000235190	462.00	112.12		EUR	51 799	0.15
SAFRAN SA	FR0000073272	116.00	106.62		EUR	12 368	0.03
HERMES INTERNACIONAL	FR0000052292	22.00	1 318.50		EUR	29 007	0.08
TELEPERFORMANCE	FR0000051807	50.00	333.40		EUR	16 670	0.05
RECKITT BENCKISER	GB00B24CGK77	195.00	60.11		GBP	14 049	0.04
OCADO GROUP PLC	GB00B3MBS747	732.00	15.04		GBP	13 195	0.04
GLENCORE PLC	JE00B4T3BW64	2 517.00	3.83		GBP	11 554	0.03
AMADEUS HOLDING SA	ES0109067019	501.00	60.54		EUR	30 331	0.09
TELEFONICA	ES0178430E18	5 926.00	4.13		EUR	24 465	0.07
BCO SANTANDER C.HISP	ES0113900J37	3 985.00	3.09		EUR	12 332	0.03
IBERDROLA	ES0144580Y14	3 955.00	10.16		EUR	40 183	0.11
FERROVIAL	ES0118900010	405.00	24.57		EUR	9 951	0.03
INDITEX	ES0148396007	1 078.00	26.74		EUR	28 826	0.08
Siemens Gamesa R	ES0143416115	325.00	19.10		EUR	6 206	0.02
GENERALI ASSUC.	IT0000062072	967.00	18.58		EUR	17 967	0.05
UNICREDITO ITALIANO	IT0005239360	4 189.00	13.99		EUR	58 604	0.17
ENI SPA	IT0003132476	951.00	13.31		EUR	12 656	0.04
ENEL	IT0003128367	5 252.00	6.78		EUR	35 614	0.10
ESSITY AKTIEBO-B	SE0009922164	547.00	261.90		SEK	13 690	0.04
ING GROEP NV	NL0011821202	5 060.00	13.06		EUR	66 094	0.19
ASML NA	NL0010273215	309.00	594.20		EUR	183 608	0.52
AKZO NOBEL NV NLG20	NL0013267909	134.00	91.56		EUR	12 269	0.03
DSM NV	NL0000009827	72.00	166.05		EUR	11 956	0.03
STELLANTIS NV	NL00150001Q9	2 895.00	16.97		EUR	49 128	0.14
ASR NEDERLAND NV	NL0011872643	571.00	41.19		EUR	23 519	0.07
Prosus NV	NL0013654783	381.00	73.44		EUR	27 981	0.08
Universal Music Grp	NL0015000IY2	771.00	21.82		EUR	16 823	0.05
NOKIA A	FI0009000681	6 916.00	5.25		EUR	36 288	0.10
SAMPO OYJ-A SHS	FI0009003305	700.00	43.85		EUR	30 695	0.09
ANHEUSER-BUSCH INB	BE0974293251	623.00	55.72		EUR	34 714	0.10
ERST BK DER OEST.SPA	AT0000652011	880.00	41.23		EUR	36 282	0.10
CRH ORD	IE0001827041	607.00	44.41		EUR	26 957	0.08
IBERDROLA DIR INC.	ES06445809N8	3 955.00	0.17		EUR	662	0.00
AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO						8 069 638	22.76

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

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	1 091.32	2 470.47		EUR	2 696 068	7.60
SCHRO-EU EQ-IZE	LU2004793787	54 485.44	53.76		EUR	2 929 110	8.26
EU STEQ-SI/ANPFE	LU1799977381	8 919.11	135.51		EUR	1 208 628	3.41
AB I-EUZ EQ S1E	LU0528104002	35 148.79	35.16		EUR	1 235 831	3.49
OBRIGAÇÕES						14 600 605	41.18
OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO						14 600 605	41.18
OBRIGAÇÕES GOVERNOS						6 508 661	18.36
DBR 1.5% 02/2023	DE0001102309	500 000.00	102.25%	7 212	EUR	518 467	1.46
DBR 0.5% 08/27	DE0001102424	300 000.00	104.10%	699	EUR	313 008	0.88
DBR 0.25% 02/2029	DE0001102465	310 000.00	103.00%	745	EUR	320 042	0.90
DBR 0% 08/2050	DE0001102481	385 000.00	93.26%		EUR	359 066	1.01
FRTR 4.25% 10/2023	FR0010466938	853 000.00	108.34%	9 833	EUR	933 965	2.63
FRTR 0.25% 11/26	FR0013200813	1 641 000.00	101.63%	764	EUR	1 668 480	4.71
SPGB 3.45% 07/66	ES00000128E2	88 000.00	146.46%	1 547	EUR	130 431	0.37
SPGB 0.45% 10/22	ES0000012A97	774 000.00	100.75%	887	EUR	780 708	2.20
SPGB 0.5% 10/2031	ES0000012I32	464 000.00	97.70%	591	EUR	453 896	1.28
BTPS 1,7% 09/2051	IT0005425233	300 000.00	91.77%	2 156	EUR	277 472	0.78
RAGB 0.75% 10/26	AT0000A1K9C8	124 000.00	104.17%	265	EUR	129 440	0.37
IRISH 0% 10/22	IE00BDHDPQ37	35 000.00	100.35%		EUR	35 122	0.10
KOREA 0% 09/2025	XS2226969686	100 000.00	99.59%		EUR	99 587	0.28
KFW 0% 04/2024	DE000A2LQSP7	245 000.00	100.79%		EUR	246 931	0.70
CCTS Float 07/2023	IT0005185456	200 000.00	100.95%	16	EUR	201 914	0.57
EU 0% 07/2026	EU000A3KTGV8	40 000.00	100.34%		EUR	40 134	0.11
OBRIGAÇÕES CRÉDITO						8 091 944	22.82
DAIGR Float 07/24	DE000A2GSCY9	300 000.00	100.73%		EUR	302 199	0.85
PBBGR Float 07/28/23	DE000A2YNV36	200 000.00	100.84%	8	EUR	201 696	0.57
DB Float 05/2022	DE000DL19TQ2	300 000.00	100.17%	153	EUR	300 669	0.85
BNP Float 09/22	XS1584041252	100 000.00	100.49%	30	EUR	100 521	0.28
SOCGEN Float 04/22	XS1586146851	200 000.00	100.12%	45	EUR	200 283	0.56
ACAFP Float 04/22	XS1598861588	100 000.00	100.16%	8	EUR	100 163	0.28
BNP Float 06/24	XS1626933102	200 000.00	101.34%	58	EUR	202 744	0.57
RENAUL Float 03/2022	FR0013260486	200 000.00	100.04%	22	EUR	200 108	0.56
GFCFP Float 06/22	FR0013266343	200 000.00	100.13%		EUR	200 254	0.56
RENAULT Float 11/24	FR0013292687	150 000.00	100.18%	1	EUR	150 274	0.42
CAFP Float 06/22	FR0013342664	100 000.00	100.05%	2	EUR	100 050	0.28
CAFP Float 09/2023	FR0013446580	100 000.00	100.47%	9	EUR	100 476	0.28
LLOYDS Float 06/2024	XS1633845158	200 000.00	101.47%	46	EUR	202 976	0.57
HSBC Float 10/23	XS1681855539	200 000.00	100.26%		EUR	200 512	0.57
BACR Float 05/2026	XS2342059784	300 000.00	101.83%	291	EUR	305 775	0.86
IBESM Float 02/24	XS1564443759	200 000.00	100.73%	42	EUR	201 498	0.57



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA VALOR
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 (%)
BBVASM Float 03/23	XS1788584321	200 000.00	100.48%	11	EUR	200 973	0.57
AMSSM Float 03/22	XS1878190757	200 000.00	100.03%		EUR	200 054	0.56
SANTAN Float 03/23	XS1689234570	200 000.00	100.68%	32	EUR	201 396	0.57
ISPIM Float 04/22	XS1599167589	200 000.00	100.16%	28	EUR	200 342	0.57
BACRED Float 05/22	XS1615501837	200 000.00	100.17%	101	EUR	200 447	0.57
BAC Float 05/23	XS1602557495	200 000.00	100.16%	105	EUR	200 423	0.57
F Float 12/24	XS1729872736	200 000.00	97.96%	45	EUR	195 965	0.55
C Float 03/23	XS1795253134	200 000.00	100.45%		EUR	200 908	0.57
BAC FLOAT 04/24	XS1811433983	200 000.00	100.45%	6	EUR	200 904	0.57
T Float 09/23	XS1907118464	200 000.00	100.94%	90	EUR	201 968	0.57
GS Float 04/2023	XS2107332483	200 000.00	100.05%		EUR	200 102	0.56
BAC Float 09/2026	XS2387929834	200 000.00	101.52%	94	EUR	203 136	0.57
DT Float 12/2022	XS1828028677	200 000.00	100.34%		EUR	200 672	0.57
BAYNGR Float 06/22	XS1840614736	200 000.00	100.13%		EUR	200 268	0.56
INTNED Float 09/23	XS1882544205	200 000.00	101.17%	62	EUR	202 410	0.57
VW Float 11/24	XS1910947941	200 000.00	103.37%	423	EUR	207 167	0.58
ANNGR Float 12/2022	DE000A19X793	200 000.00	100.30%		EUR	200 606	0.57
JYBC Float 12/22	XS1726323436	100 000.00	100.37%	5	EUR	100 370	0.28
KBCBB Float 11/22	BE0002281500	100 000.00	100.37%		EUR	100 369	0.28
ABIBB Float 04/24	BE6301509012	200 000.00	100.58%		EUR	201 156	0.57
DLTAS 2008-1 A	XS0390756285	22 475.32	99.91%		EUR	22 456	0.06
DHR Float 06/22	XS1637162246	200 000.00	100.15%		EUR	200 298	0.56
SUMIBK Float 06/22	XS1621087359	200 000.00	100.14%		EUR	200 286	0.56
MIZUHO Float 04/23	XS1801906279	200 000.00	100.49%		EUR	200 988	0.57
TACHEM Float 11/22	XS1843449809	200 000.00	100.74%	211	EUR	201 685	0.57
MUFG Float 05/2023	XS1828132735	200 000.00	100.52%		EUR	201 048	0.57
BMO Float 03/22	XS1791326728	100 000.00	100.06%		EUR	100 056	0.28
GS Float 07/2022	XS1173867323	75 000.00	100.38%	6	EUR	75 294	0.21
ALTERNATIVOS						304 954	0.86
CAIXA PRIVATE EQUITY	PTYME4LE0005	16 936.00	6.33		EUR	107 212	0.30
CAIXA INFRAESTRUTURA	PTYME7LE0002	24 958.00	7.92		EUR	197 742	0.56
IMOBILIÁRIO						4 891 575	13.80
IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO						4 891 575	13.80
CXG IMOBILIARIO	PTYMESHE0009	182 714.00	4.43		EUR	809 295	2.28
FUNDIESTAMO I	PTGFIBIM0004	58.00	1 169.08		EUR	67 807	0.19
Fundimo	PTYCXTHM0007	499 530.00	8.04		EUR	4 014 473	11.32
LIQUIDEZ						4 757 467	13.42
TOTAL						35 458 460	100.00



CGD Pensões

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

Saldos de Unidades de Participação

	Peso (%)	Valor (EUR)
Valor (EUR)	100.00	35 458 460.360000
Quantidade		5 166 109.964099
Cotação 2022-02-01 (EUR)		6.863700

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