



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA MODERADO
Composição da Carteira em: 2022-03-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
AÇÕES						11 611 801	33.04
AÇÕES EUA						3 004 802	8.55
AÇÕES EUA - INV. DIRETO						0	0.00
ESM2 S&P500 06/22	91004070052	3.00	4 578.75		USD	0	0.00
AÇÕES EUA - INV. INDIRETO						3 004 802	8.55
T ROWE ROWE PRICE QR	LU1136108674	27 745.89	31.67		EUR	878 712	2.50
MORGAN-US AD-Z\$	LU0360484686	7 434.19	138.17		USD	925 890	2.63
ISHARES S&P500 VALUE	US4642874089	5 819.00	157.63		USD	826 797	2.35
ISH MSCI PAC XJP	IE00B52MJY50	2 293.00	180.66		USD	373 403	1.06
AÇÕES ÁSIA						1 234 900	3.51
AÇÕES ÁSIA - INV. INDIRETO						1 234 900	3.51
T ROWE PRICE-JAP EQY	LU0230817925	40 671.90	16.96		EUR	689 795	1.96
X MSCI JAPAN EUR	LU0659580079	21 713.00	25.11		EUR	545 105	1.55
AÇÕES EUROPEIAS						6 320 194	17.98
AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO						1 962 619	5.58
EDP Renováveis	ES0127797019	1 001.00	23.34		EUR	23 363	0.07
VGM2 EUR EUX 06/22	DE000C5HZK47	15.00	3 826.00		EUR	0	0.00
BMW	DE0005190003	181.00	78.60		EUR	14 227	0.04
SIEMENS	DE0007236101	509.00	125.66		EUR	63 961	0.18
ALLIANZ	DE0008404005	142.00	216.55		EUR	30 750	0.09
E.ON AG(EX VEBA AG)	DE000ENAG999	1 305.00	10.54		EUR	13 757	0.04
BASF	DE000BASF111	531.00	51.76		EUR	27 485	0.08
BAYER AG	DE000BAY0017	666.00	62.10		EUR	41 359	0.12
RWE-RHEINISCH WEST..	DE0007037129	363.00	39.53		EUR	14 349	0.04
ADIDAS- SALOMON AG	DE000A1EWWW0	83.00	211.90		EUR	17 588	0.05
MERCK KGAA	DE0006599905	77.00	189.85		EUR	14 618	0.04
SAP SE	DE0007164600	423.00	101.12		EUR	42 774	0.12
DEUTSCHE TELEKOM	DE0005557508	2 516.00	16.93		EUR	42 601	0.12
Mercedes-Benz Grp AG	DE0007100000	522.00	63.81		EUR	33 309	0.09
INFINEON TECHNOLOGIE	DE0006231004	325.00	30.99		EUR	10 070	0.03
DEUTSCHE POST	DE0005552004	738.00	43.55		EUR	32 140	0.09
DEUTSCHE BOERSE AG	DE0005810055	151.00	163.00		EUR	24 613	0.07
VOLKSWAGEN AG-PREF.	DE0007664039	125.00	157.00		EUR	19 625	0.06
DANONE	FR0000120644	271.00	50.03		EUR	13 558	0.04
AXA-UAP	FR0000120628	413.00	26.57		EUR	10 971	0.03
CARREFOUR	FR0000120172	768.00	19.65		EUR	15 087	0.04
PERNOD RICARD	FR0000120693	155.00	199.30		EUR	30 892	0.09
TotalEnergies SE	FR0000120271	1 363.00	46.03		EUR	62 739	0.18

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA MODERADO
Composição da Carteira em: 2022-03-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
L OREAL	FR0000120321	135.00	363.85		EUR	49 120	0.14
Kering	FR0000121485	42.00	575.70		EUR	24 179	0.07
BNP	FR0000131104	446.00	51.93		EUR	23 161	0.07
AIR LIQUIDE	FR0000120073	322.00	158.92		EUR	51 172	0.15
SCHNEIDER	FR0000121972	223.00	152.16		EUR	33 932	0.10
L.V.M.H.	FR0000121014	162.00	649.40		EUR	105 203	0.30
MICHELIN	FR0000121261	157.00	122.95		EUR	19 303	0.05
SAINT-GOBAIN	FR0000125007	486.00	54.27		EUR	26 375	0.08
THOMSON	FR0000121329	138.00	113.95		EUR	15 725	0.04
SOCIETE GENERALE	FR0000130809	1 373.00	24.46		EUR	33 584	0.10
CAP GEMINI SOGETI	FR0000125338	180.00	202.50		EUR	36 450	0.10
EssilorLuxottica	FR0000121667	145.00	166.30		EUR	24 114	0.07
GLE ENTREP. VINCI	FR0000125486	309.00	92.99		EUR	28 734	0.08
SANOFI SYNHLABO	FR0000120578	562.00	92.51		EUR	51 991	0.15
VEOLIA ENVIRONEMENT	FR0000124141	482.00	29.09		EUR	14 021	0.04
AIRBUS SE	NL0000235190	388.00	110.36		EUR	42 820	0.12
SAFRAN SA	FR0000073272	91.00	107.26		EUR	9 761	0.03
HERMES INTERNACIONAL	FR0000052292	24.00	1 291.50		EUR	30 996	0.09
TELEPERFORMANCE	FR0000051807	29.00	346.30		EUR	10 043	0.03
RECKITT BENCKISER	GB00B24CGK77	210.00	58.32		GBP	14 517	0.04
OCADO GROUP PLC	GB00B3MBS747	671.00	11.71		GBP	9 314	0.03
GLENCORE PLC	JE00B4T3BW64	1 705.00	5.00		GBP	10 105	0.03
ASHTREAD GROUP PLC	GB0000536739	148.00	48.33		GBP	8 479	0.02
AMADEUS HOLDING SA	ES0109067019	421.00	59.18		EUR	24 915	0.07
SHELL PLC-NEW	GB00BP6MXD84	345.00	24.96		EUR	8 609	0.02
TELEFONICA	ES0178430E18	4 752.00	4.39		EUR	20 854	0.06
BCO SANTANDER C.HISP	ES0113900J37	3 081.00	3.10		EUR	9 551	0.03
FERROVIAL	ES0118900010	380.00	24.13		EUR	9 169	0.03
INDITEX	ES0148396007	905.00	19.78		EUR	17 901	0.05
CAIXABANK SA	ES0140609019	10 517.00	3.08		EUR	32 361	0.09
Siemens Gamesa R	ES0143416115	369.00	15.98		EUR	5 895	0.02
GENERALI ASSUC.	IT0000062072	910.00	20.77		EUR	18 901	0.05
UNICREDITO ITALIANO	IT0005239360	3 965.00	9.86		EUR	39 075	0.11
ENI SPA	IT0003132476	799.00	13.29		EUR	10 622	0.03
ENEL	IT0003128367	4 026.00	6.07		EUR	24 430	0.07
ESSITY AKTIEBO-B	SE0009922164	457.00	222.20		SEK	9 793	0.03
C.FIN.RICHMONT	CH0210483332	88.00	118.00		CHF	10 160	0.03
KONINKLIJKE AHOLD NV	NL0011794037	836.00	29.12		EUR	24 340	0.07
ING GROEP NV	NL0011821202	4 537.00	9.51		EUR	43 151	0.12
KONINKLIJKE PHILIPS	NL0000009538	668.00	27.73		EUR	18 524	0.05

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA MODERADO
Composição da Carteira em: 2022-03-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
ASML NA	NL0010273215	260.00	610.00		EUR	158 600	0.45
AKZO NOBEL NV NLG20	NL0013267909	179.00	78.22		EUR	14 001	0.04
DSM NV	NL0000009827	60.00	162.50		EUR	9 750	0.03
STELLANTIS NV	NL00150001Q9	2 283.00	14.80		EUR	33 788	0.10
ASR NEDERLAND NV	NL0011872643	580.00	42.23		EUR	24 493	0.07
Universal Music Grp	NL0015000IY2	614.00	24.20		EUR	14 856	0.04
NOKIA A	FI0009000681	6 039.00	4.99		EUR	30 107	0.09
SAMPO OYJ-A SHS	FI0009003305	543.00	44.38		EUR	24 098	0.07
ERST BK DER OEST.SPA	AT0000652011	899.00	33.09		EUR	29 748	0.08
CRH ORD	IE0001827041	605.00	36.35		EUR	21 992	0.06
AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO						4 357 575	12.40
ALLIANZ RCM EUR EQTY	LU0852482198	538.30	2 374.56		EUR	1 278 221	3.64
SCHRO-EU EQ-IZE	LU2004793787	23 674.93	53.86		EUR	1 275 042	3.63
EU STEQ-SI/ANPFE	LU1799977381	4 149.64	130.36		EUR	540 948	1.54
AB I-EUZ EQ S1E	LU0528104002	15 948.38	33.70		EUR	537 461	1.53
ISHARES SMI CH	CH0008899764	1 826.00	126.34		CHF	225 724	0.64
ISHARES PLC FTSE 100	IE0005042456	57 045.00	7.40		GBP	500 180	1.42
AÇÕES EMERGENTES						1 051 904	2.99
AÇÕES EMERGENTES - INV. INDIRETO						1 051 904	2.99
GS-EMRG MKT E-I AC	LU1357028627	27 702.55	19.05		EUR	527 733	1.50
WELL-EM MK RE-SE	LU2058844833	56 683.67	9.25		EUR	524 171	1.49
OBRIGAÇÕES						14 885 270	42.36
OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO						8 665 674	24.66
OBRIGAÇÕES GOVERNOS						3 157 967	8.99
OT 2.875% 10/2025	PTOTEKOE0011	45 000.00	108.38%	595	EUR	49 368	0.14
DBR 1% 08/2025	DE0001102382	109 000.00	102.75%	684	EUR	112 678	0.32
OBL 0% 10/2024	DE0001141802	489 000.00	99.89%		EUR	488 438	1.39
FRTR 0% 03/2024	FR0013344751	111 000.00	99.95%		EUR	110 947	0.32
FRTR 0% 03/2025	FR0013415627	675 000.00	99.13%		EUR	669 141	1.90
SPGB 0% 05/2024	ES0000012H33	329 000.00	99.55%		EUR	327 520	0.93
SPGB 0% 01/2027	ES0000012J15	111 000.00	96.02%		EUR	106 577	0.30
BTPS 0.6% 06/2023	IT0005405318	409 000.00	100.97%	721	EUR	413 697	1.18
BTPS 0% 08/2026	IT0005454241	375 000.00	95.05%		EUR	356 426	1.01
NETHER 0% 01/2026	NL0015000QL2	102 000.00	98.58%		EUR	100 555	0.29
RFGB 0% 09/2024	FI4000391529	54 000.00	99.64%		EUR	53 804	0.15
BGB 0.5% 10/2024	BE0000342510	192 000.00	101.00%	423	EUR	194 351	0.55
RAGB 0% 07/2024	AT0000A28KX7	131 000.00	99.80%		EUR	130 735	0.37
IRISH 5.4% 03/2025	IE00B4TV0D44	38 000.00	114.80%	107	EUR	43 731	0.12
OBRIGAÇÕES CRÉDITO						5 507 707	15.67
GALPPL 2% 01/2026	PTGALCOM0013	100 000.00	100.87%	416	EUR	101 286	0.29

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA MODERADO
Composição da Carteira em: 2022-03-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
BCPPL 1.125% 02/2027	PTBCPHOM0066	100 000.00	89.26%	148	EUR	89 408	0.25
FIDELI 4.25% 09/2031	PTFIDBOM0009	100 000.00	101.69%	2 434	EUR	104 119	0.30
CXGD 0.375% 09/2027	PTCGDCOM0037	100 000.00	93.52%	197	EUR	93 717	0.27
EUROGR 1.625% 11/23	XS1315101011	100 000.00	101.63%	663	EUR	102 296	0.29
MRKGR 1.625% 06/2079	XS2011260531	100 000.00	99.72%	463	EUR	100 183	0.29
ADSGR 0% 09/2024	XS2224621347	100 000.00	98.13%		EUR	98 125	0.28
DB 1% 11/2025	DE000DL19VR6	100 000.00	98.03%	364	EUR	98 394	0.28
NRPBBGR 0.1% 02/2026	DE000A3H2ZX9	100 000.00	95.11%	16	EUR	95 130	0.27
VW 0.125% 02/2027	XS2374595044	100 000.00	91.83%	16	EUR	91 845	0.26
PEUGOT 2.375% 04/23	FR0013153707	100 000.00	102.02%	2 290	EUR	104 313	0.30
RENAUL 0.75% 04/2023	FR0013412699	100 000.00	99.99%	732	EUR	100 722	0.29
SWFP 0.5% 01/2024	XS2203995910	100 000.00	99.94%	101	EUR	100 044	0.28
SSELN 1.75% 09/2023	XS1287779208	100 000.00	101.82%	983	EUR	102 803	0.29
HSBC 1.5% 12/2024	XS1917601582	100 000.00	101.37%	485	EUR	101 855	0.29
LLOYDS 0.375% 01/25	XS2109394077	100 000.00	98.24%	65	EUR	98 305	0.28
BPLN 3.25% PERP	XS2193661324	100 000.00	100.18%	2 520	EUR	102 704	0.29
VMUKLN 2.875% 06/25	XS2126084750	100 000.00	102.43%	774	EUR	103 204	0.29
NWG 1.375% 03/2027	XS2449911143	100 000.00	98.31%	113	EUR	98 427	0.28
MRLSM 2.225% 04/23	XS1398336351	100 000.00	101.42%	2 079	EUR	103 496	0.29
KUTXAB 0.5% 09/2024	ES0343307015	100 000.00	98.64%	258	EUR	98 894	0.28
SANSCF 0.375% 01/25	XS2100690036	100 000.00	98.07%	76	EUR	98 141	0.28
CLNXSM 0.75% 11/2026	XS2300292617	100 000.00	92.65%	282	EUR	92 930	0.26
SWEDA 0.25% 10/2024	XS2063261155	100 000.00	98.06%	119	EUR	98 180	0.28
TRNIM 1% 07/2023	XS1858912915	100 000.00	100.92%	690	EUR	101 610	0.29
ISPIM 1% 07/2024	XS2022425297	100 000.00	100.15%	742	EUR	100 887	0.29
KHC 1.5% 05/24	XS1405782407	100 000.00	100.88%	1 282	EUR	102 158	0.29
JPM 0.625% 01/2024	XS1456422135	100 000.00	100.34%	113	EUR	100 448	0.29
MS 1.875% 03/23	XS1115208107	100 000.00	101.87%	10	EUR	101 877	0.29
UPS 0.375% 11/23	XS1718480327	100 000.00	100.03%	141	EUR	100 172	0.29
EMR 0.375% 05/2024	XS1999902502	100 000.00	99.20%	323	EUR	99 520	0.28
ITW 0.25% 12/2024	XS1843435253	100 000.00	98.72%	80	EUR	98 803	0.28
F 1.514% 02/2023	XS2013574202	100 000.00	100.05%	178	EUR	100 225	0.29
FISV 0.375% 07/2023	XS1843434017	100 000.00	100.13%	282	EUR	100 414	0.29
JEF 1% 07/2024	XS2030530450	100 000.00	100.04%	701	EUR	100 743	0.29
TMO 0.125% 03/2025	XS2058556296	100 000.00	97.42%	11	EUR	97 434	0.28
BAC 1.379% 02/2025	XS1560863802	100 000.00	100.85%	200	EUR	101 054	0.29
DLR 2.5% 01/2026	XS1891174341	100 000.00	102.31%	514	EUR	102 825	0.29
PHIANA 0.75% 05/2024	XS1815116568	100 000.00	100.20%	686	EUR	100 881	0.29
INTNED 3% 04/2028	XS1590823859	100 000.00	102.17%	2 918	EUR	105 086	0.30
NIBCAP 0.875% 07/25	XS2023631489	100 000.00	98.17%	640	EUR	98 808	0.28



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA MODERADO
Composição da Carteira em: 2022-03-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
ENELIM 0% 06/2024	XS2066706818	100 000.00	98.24%		EUR	98 239	0.28
RELLN 0% 03/2024	XS2126161681	100 000.00	98.76%		EUR	98 759	0.28
REPSM 0.125% 10/2024	XS2241090088	100 000.00	98.36%	61	EUR	98 422	0.28
ANNGR 1.5% 06/2026	DE000A182VT2	100 000.00	99.17%	1 212	EUR	100 377	0.29
SIEGR 0.375% 06/26	XS2182054887	100 000.00	97.59%	308	EUR	97 902	0.28
INTNED 1.25% 02/27	XS2443920249	100 000.00	98.69%	151	EUR	98 836	0.28
CARLB 2.5% 05/2024	XS1071713470	100 000.00	102.74%	2 110	EUR	104 849	0.30
DANBNK 0.875% 05/23	XS1799061558	100 000.00	100.64%	753	EUR	101 393	0.29
NYKRE 0.75% 01/2027	DK0009526998	100 000.00	95.37%	146	EUR	95 520	0.27
SPOLNO 0.25% 09/2024	XS2057872595	100 000.00	98.38%	125	EUR	98 505	0.28
DLTAS 2008-1 A	XS0390756285	18 844.28	99.87%		EUR	18 820	0.05
GLENLN 1.875% 09/23	XS1489184900	100 000.00	101.14%	1 027	EUR	102 164	0.29
TACHEM 2.25% 11/2026	XS1843449122	100 000.00	103.71%	808	EUR	104 513	0.30
ERSTBK 0.375% 04/24	XS1982725159	100 000.00	98.87%	360	EUR	99 232	0.28
RY 0.125% 07/2024	XS2031862076	100 000.00	98.62%	86	EUR	98 709	0.28
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO						6 219 596	17.70
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO - GOVERNOS						3 183 336	9.06
BLUEBAY INV GR EUR G	LU0549539178	2 369.11	174.30		EUR	412 936	1.18
JPM F-EU GVT-I€	LU0355584201	3 312.66	124.03		EUR	410 873	1.17
BGF-EMKLCB-I2€	LU1559746307	32 891.52	21.15		EUR	695 656	1.98
XUS TREASURY €	LU1399300455	15 360.00	108.33		EUR	1 663 872	4.73
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO - CORPORATE						3 036 260	8.64
VONTOBEL EUR CRP MID	LU0278087860	1 377.39	167.03		EUR	230 065	0.65
EAST-US CB-CE HG	LU1245751505	91 054.09	11.00		EUR	1 001 140	2.85
PGIS-CR BD-IN€HA	IE00BDBBRD46	98 064.90	10.36		EUR	1 015 952	2.89
LORD ABB-HIG YLD-€IH	IE00BJ7BPF87	25 933.71	13.25		EUR	343 622	0.98
BGF-EUR CORP-I2	LU1373033965	20 210.27	11.05		EUR	223 323	0.64
ESIF-M&G EC-FA€	LU2101367030	2 193.50	101.28		EUR	222 158	0.63
MATÉRIAS PRIMAS						328 334	0.93
GS-GSQ MOD-C	LU0397156430	26 026.83	14.00		USD	328 334	0.93
ALTERNATIVOS						307 110	0.87
CAIXA PRIVATE EQUITY	PTYME4LE0005	16 936.00	6.33		EUR	107 201	0.31
CAIXA INFRAESTRUTURA	PTYME7LE0002	24 958.00	8.01		EUR	199 909	0.57
IMOBILIÁRIO						4 951 099	14.09
IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO						4 951 099	14.09
CXG IMOBILIARIO	PTYMESHE0009	182 714.00	4.50		EUR	821 701	2.34
FUNDIESTAMO I	PTGFIBIM0004	58.00	1 184.79		EUR	68 718	0.20
Fundimo	PTYCXTHM0007	499 530.00	8.13		EUR	4 060 679	11.55
LIQUIDEZ						3 058 843	8.70
TOTAL						35 142 456	100.00



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA MODERADO
Composição da Carteira em: 2022-03-31

Saldos de Unidades de Participação

	Peso (%)	Valor (EUR)
Valor (EUR)	100.00	35 142 456.180000
Quantidade		5 195 339.159159
Cotação 2022-04-01 (EUR)		6.764200

Câmbios

CHF / EUR	0.978445
DKK / EUR	0.134419
EUR / EUR	1.000000
GBP / EUR	1.185368
NOK / EUR	0.102933
SEK / EUR	0.096438
USD / EUR	0.901388