



# CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA  
FUNDO: CAIXA REFORMA VALOR  
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>11 694 966</b>	<b>33.27</b>
AÇÕES EUA						198	0.00
AÇÕES EUA - INV. DIRETO						0	0.00
ESU1 S&P500 09/21	91004070049	2.00	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						11 376 542	32.36
AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO						2 354 773	6.70
EDP Renováveis	ES0127797019	1 144.00	19.80		EUR	22 651	0.06
VGU1 EUR EUX 09/21	DE000C4FMQL5	9.00	4 090.00		EUR	0	0.00
BMW	DE0005190003	463.00	83.88		EUR	38 836	0.11
DEUTSCHE BANK	DE0005140008	3 219.00	10.66		EUR	34 308	0.10
SIEMENS	DE0007236101	640.00	131.58		EUR	84 211	0.24
ALLIANZ	DE0008404005	139.00	210.00		EUR	29 190	0.08
BASF	DE000BASF111	567.00	66.22		EUR	37 547	0.11
BAYER AG	DE000BAY0017	1 169.00	50.29		EUR	58 789	0.17
RWE-RHEINISCH WEST..	DE0007037129	271.00	30.01		EUR	8 133	0.02
ADIDAS- SALOMON AG	DE000A1EWWW0	95.00	306.10		EUR	29 080	0.08
SAP SE	DE0007164600	412.00	120.84		EUR	49 786	0.14
DEUTSCHE TELEKOM	DE0005557508	2 985.00	17.51		EUR	52 255	0.15
DAIMLER CHRYSLER	DE0007100000	352.00	75.28		EUR	26 499	0.08
INFINEON TECHNOLOGIE	DE0006231004	232.00	32.14		EUR	7 455	0.02
DEUTSCHE POST	DE0005552004	1 270.00	57.11		EUR	72 530	0.21
VOLKSWAGEN AG-PREF.	DE0007664039	100.00	205.50		EUR	20 550	0.06
FRESENIUS SE&CO KGAA	DE0005785604	466.00	44.32		EUR	20 653	0.06
SIEMENS HEALTHIN	DE000SHL1006	450.00	55.68		EUR	25 056	0.07
Siemens Energy AG	DE000ENER6Y0	320.00	22.94		EUR	7 341	0.02
DANONE	FR0000120644	476.00	62.06		EUR	29 541	0.08
AXA-UAP	FR0000120628	582.00	21.88		EUR	12 734	0.04
PERNOD RICARD	FR0000120693	221.00	186.10		EUR	41 128	0.12
TotalEnergies SE	FR0000120271	1 382.00	36.70		EUR	50 719	0.14
L OREAL	FR0000120321	221.00	385.90		EUR	85 284	0.24
Kering	FR0000121485	51.00	756.20		EUR	38 566	0.11
BNP	FR0000131104	1 093.00	51.45		EUR	56 235	0.16
AIR LIQUIDE	FR0000120073	281.00	146.58		EUR	41 189	0.12
SCHNEIDER	FR0000121972	181.00	141.30		EUR	25 575	0.07
L.V.M.H.	FR0000121014	187.00	673.90		EUR	126 019	0.36



# CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA  
FUNDO: CAIXA REFORMA VALOR  
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	108.00	137.70		EUR	14 872	0.04
SAINT-GOBAIN	FR0000125007	529.00	60.25		EUR	31 872	0.09
BOUYGUES	FR0000120503	354.00	32.49		EUR	11 501	0.03
EssilorLuxottica	FR0000121667	177.00	159.16		EUR	28 171	0.08
GLE ENTREP. VINCI	FR0000125486	379.00	89.21		EUR	33 811	0.10
ST MICROELECTRON	NL0000226223	895.00	34.53		EUR	30 900	0.09
DASSAULT SYSTEMES	FR0014003TT8	715.00	46.52		EUR	33 262	0.09
SANOFI SYNHLABO	FR0000120578	657.00	86.88		EUR	57 080	0.16
AIRBUS SE	NL0000235190	444.00	115.70		EUR	51 371	0.15
CREDIT AGRICOLE SA	FR0000045072	2 322.00	11.76		EUR	27 307	0.08
ILIAD SA	FR0004035913	127.00	182.05		EUR	23 120	0.07
SAFRAN SA	FR0000073272	111.00	110.30		EUR	12 243	0.03
HERMES INTERNACIONAL	FR0000052292	18.00	1 289.00		EUR	23 202	0.07
TELEPERFORMANCE	FR0000051807	48.00	355.60		EUR	17 069	0.05
RECKITT BENCKISER	GB00B24CGK77	187.00	55.23		GBP	12 111	0.03
ANGLO AMERICAN PLC	GB00B1XZS820	539.00	31.91		GBP	20 166	0.06
OCADO GROUP PLC	GB00B3MBS747	703.00	18.55		GBP	15 292	0.04
TELEFONICA	ES0178430E18	2 461.00	3.87		EUR	9 514	0.03
BCO SANTANDER C.HISP	ES0113900J37	15 376.00	3.09		EUR	47 473	0.14
IBERDROLA	ES0144580Y14	3 797.00	10.16		EUR	38 578	0.11
FERROVIAL	ES0118900010	389.00	25.00		EUR	9 725	0.03
INDITEX	ES0148396007	1 035.00	28.59		EUR	29 591	0.08
TELECOM ITALIA	IT0003497168	29 041.00	0.37		EUR	10 771	0.03
UNICREDITO ITALIANO	IT0005239360	3 036.00	10.11		EUR	30 688	0.09
ENI SPA	IT0003132476	833.00	10.02		EUR	8 350	0.02
ENEL	IT0003128367	5 042.00	7.78		EUR	39 227	0.11
ESSITY AKTIEBO-B	SE0009922164	525.00	281.50		SEK	14 497	0.04
ZURICH ALLIED AG	CH0011075394	40.00	365.80		CHF	13 612	0.04
ASML NA	NL0010273215	318.00	639.00		EUR	203 202	0.58
AKZO NOBEL NV NLG20	NL0013267909	253.00	104.10		EUR	26 337	0.07
DSM NV	NL0000009827	172.00	169.95		EUR	29 231	0.08
STELLANTIS NV	NL00150001Q9	2 779.00	16.19		EUR	44 992	0.13
Prosus NV	NL0013654783	366.00	74.85		EUR	27 395	0.08
Adyen NV	NL0012969182	6.00	2 289.50		EUR	13 737	0.04
SAMPO OYJ-A SHS	FI0009003305	1 018.00	40.62		EUR	41 351	0.12
Neste Oyj	FI0009013296	222.00	51.82		EUR	11 504	0.03
KBC BANKVERZEKERING	BE0003565737	601.00	67.90		EUR	40 808	0.12
ANHEUSER-BUSCH INB	BE0974293251	598.00	53.40		EUR	31 933	0.09
ERST BK DER OEST.SPA	AT0000652011	1 093.00	32.71		EUR	35 752	0.10
CRH ORD	IE0001827041	504.00	42.25		EUR	21 294	0.06



# CGD Pensões

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

## COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
<b>AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO</b>						<b>9 021 770</b>	<b>25.66</b>
ALLIANZ RCM EUR EQTY	LU0852482198	1 186.75	2 741.81		EUR	3 253 829	9.26
AB SCV I-EUZ EQ I	LU0528103707	84 593.00	33.58		EUR	2 840 633	8.08
SCHRO-EU EQ-IZE	LU2004793787	52 900.60	55.34		EUR	2 927 308	8.33
<b>AÇÕES EMERGENTES</b>						<b>318 225</b>	<b>0.91</b>
<b>AÇÕES EMERGENTES - INV. INDIRETO</b>						<b>318 225</b>	<b>0.91</b>
ISHARES MSCI EMER.MK	US4642872349	7 297.00	51.74		USD	318 225	0.91
<b>OBRIGAÇÕES</b>						<b>15 642 134</b>	<b>44.50</b>
<b>OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO</b>						<b>13 457 411</b>	<b>38.28</b>
<b>OBRIGAÇÕES GOVERNOS</b>						<b>5 051 943</b>	<b>14.37</b>
DBR 1.5% 02/2023	DE0001102309	255 000.00	103.53%	1 750	EUR	265 746	0.76
DBR 1.25% 08/48	DE0001102432	190 000.00	134.36%	2 284	EUR	257 568	0.73
DBR 0.25% 02/2029	DE0001102465	10 000.00	106.92%	11	EUR	10 704	0.03
DBR 0% 08/2050	DE0001102481	62 000.00	99.42%		EUR	61 642	0.18
BKO 0% 09/2021	DE0001104776	9 000.00	100.05%		EUR	9 004	0.03
BKO 0% 09/2022	DE0001104818	179 000.00	100.85%		EUR	180 523	0.51
FRTR 4.25% 10/2023	FR0010466938	613 000.00	111.20%	19 985	EUR	701 666	2.00
FRTR 0.25% 11/26	FR0013200813	841 000.00	104.51%	1 434	EUR	880 389	2.50
SPGB 3.45% 07/66	ES00000128E2	88 000.00	163.22%	17	EUR	143 653	0.41
SPGB 0.45% 10/22	ES0000012A97	774 000.00	101.37%	2 615	EUR	787 187	2.24
SPGB 0.5% 10/2031	ES0000012I32	364 000.00	102.34%	165	EUR	372 697	1.06
BTPS 4% 2/2037	IT0003934657	120 000.00	141.32%	2 400	EUR	171 985	0.49
BTPS 3.45% 03/48	IT0005273013	313 000.00	141.24%	4 490	EUR	446 577	1.27
RAGB 0.75% 10/26	AT0000A1K9C8	124 000.00	107.33%	726	EUR	133 817	0.38
IRISH 0% 10/22	IE00BDHDPQ37	35 000.00	100.75%		EUR	35 261	0.10
KOREA 0% 09/2025	XS2226969686	100 000.00	100.91%		EUR	100 906	0.29
KFW 0% 04/2024	DE000A2LQSP7	245 000.00	101.69%		EUR	249 133	0.71
CCTS Float 07/2023	IT0005185456	200 000.00	101.16%	18	EUR	202 346	0.58
EU 0% 07/2026	EU000A3KTGV8	40 000.00	102.85%		EUR	41 139	0.12
<b>OBRIGAÇÕES CRÉDITO</b>						<b>8 405 467</b>	<b>23.91</b>
DAIGR Float 07/24	DE000A2GSCY9	300 000.00	100.66%		EUR	301 980	0.86
VW Float 12/21	XS1830992563	200 000.00	100.18%	46	EUR	200 412	0.57
PBBGR Float 07/28/23	DE000A2YINV36	200 000.00	100.95%	8	EUR	201 912	0.57
DB Float 05/2022	DE000DL19TQ2	300 000.00	100.39%	164	EUR	301 322	0.86
BNP Float 09/22	XS1584041252	100 000.00	100.87%	34	EUR	100 899	0.29
SOCGEN Float 04/22	XS1586146851	200 000.00	100.52%	53	EUR	201 085	0.57
ACAFP Float 04/22	XS1598861588	100 000.00	100.52%	8	EUR	100 530	0.29
BNP Float 06/24	XS1626933102	200 000.00	101.42%	64	EUR	202 902	0.58
RENAUL Float 03/2022	FR0013260486	200 000.00	100.25%	33	EUR	200 533	0.57
GFCFP Float 06/22	FR0013266343	200 000.00	100.28%		EUR	200 562	0.57



# CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA  
FUNDO: CAIXA REFORMA VALOR  
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 (%)
RENAULT Float 11/24	FR0013292687	50 000.00	100.32%	4	EUR	50 164	0.14
CAFP Float 06/22	FR0013342664	100 000.00	100.20%	9	EUR	100 206	0.29
ACAFP Float 01/2022	FR0013396777	100 000.00	100.24%	0	EUR	100 236	0.29
CAFP Float 09/2023	FR0013446580	100 000.00	100.57%	14	EUR	100 585	0.29
LLOYDS Float 06/2024	XS1633845158	200 000.00	101.40%	54	EUR	202 848	0.58
HSBC Float 10/23	XS1681855539	200 000.00	100.39%		EUR	200 780	0.57
RBS Float 09/21	XS1884702207	100 000.00	100.13%	34	EUR	100 160	0.28
BACR Float 05/2026	XS2342059784	300 000.00	102.04%	315	EUR	306 432	0.87
IBESM Float 02/24	XS1564443759	200 000.00	100.75%	47	EUR	201 551	0.57
BBVASM Float 03/23	XS1788584321	200 000.00	100.68%	16	EUR	201 382	0.57
AMSSM Float 03/22	XS1878190757	200 000.00	100.00%		EUR	200 002	0.57
SANTAN Float 03/23	XS1689234570	200 000.00	100.93%	40	EUR	201 894	0.57
ISPIM Float 04/22	XS1599167589	200 000.00	100.58%	29	EUR	201 187	0.57
BACRED Float 05/22	XS1615501837	200 000.00	100.44%	105	EUR	200 989	0.57
WFC Float 01/22	XS1558022866	100 000.00	100.22%		EUR	100 219	0.29
BAC Float 05/23	XS1602557495	100 000.00	100.46%	61	EUR	100 518	0.29
MS Float 11/22	XS1603892065	200 000.00	100.16%	77	EUR	200 403	0.57
F Float 12/21	XS1729872652	100 000.00	99.85%		EUR	99 850	0.28
F Float 12/24	XS1729872736	200 000.00	97.43%	53	EUR	194 907	0.55
C Float 03/23	XS1795253134	200 000.00	100.63%		EUR	201 258	0.57
BAC FLOAT 04/24	XS1811433983	200 000.00	100.66%	5	EUR	201 317	0.57
T Float 09/23	XS1907118464	200 000.00	101.18%	99	EUR	202 463	0.58
GS Float 04/2023	XS2107332483	200 000.00	100.18%	0	EUR	200 350	0.57
DT Float 12/2022	XS1828028677	200 000.00	100.51%		EUR	201 010	0.57
BAYNGR Float 06/22	XS1840614736	200 000.00	100.26%	2	EUR	200 514	0.57
INTNED Float 09/23	XS1882544205	200 000.00	101.50%	70	EUR	203 064	0.58
VW Float 11/24	XS1910947941	100 000.00	103.80%	213	EUR	104 010	0.30
ANNGR Float 12/2022	DE000A19X793	200 000.00	100.38%		EUR	200 768	0.57
JYBC Float 12/22	XS1726323436	100 000.00	100.61%	10	EUR	100 622	0.29
KBCBB Float 11/22	BE0002281500	100 000.00	100.59%	1	EUR	100 595	0.29
ABIBB Float 04/24	BE6301509012	200 000.00	100.53%		EUR	201 054	0.57
DLTAS 2008-1 A	XS0390756285	29 746.35	99.88%		EUR	29 711	0.08
DHR Float 06/22	XS1637162246	200 000.00	100.26%		EUR	200 512	0.57
SUMIBK Float 06/22	XS1621087359	200 000.00	100.37%		EUR	200 744	0.57
MIZUHO Float 04/23	XS1801906279	200 000.00	100.67%		EUR	201 342	0.57
TACHEM Float 11/22	XS1843449809	200 000.00	101.17%	219	EUR	202 559	0.58
MUFG Float 05/2023	XS1828132735	200 000.00	100.63%	5	EUR	201 259	0.57
BMO Float 03/22	XS1791326728	100 000.00	100.31%		EUR	100 312	0.29
GS Float 07/2022	XS1173867323	75 000.00	100.73%	6	EUR	75 552	0.21
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO						2 184 723	6.21



# CGD Pensões

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

## COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO > OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO - CORPORATE

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
<b>OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO - CORPORATE</b>						<b>2 184 723</b>	<b>6.21</b>
NORDEA 1-EUHY-BI-EUR	LU0141799097	16 799.38	40.15		EUR	674 495	1.92
LORD ABB-HIG YLD-€IH	IE00BJ7BPF87	24 472.17	13.96		EUR	341 631	0.97
ISHARES EUR CORP.BON	IE0032523478	8 240.00	141.82		EUR	1 168 597	3.32
<b>ALTERNATIVOS</b>						<b>290 475</b>	<b>0.83</b>
CAIXA PRIVATE EQUITY	PTYME4LE0005	16 936.00	6.10		EUR	103 335	0.29
CAIXA INFRAESTRUTURA	PTYME7LE0002	24 958.00	7.50		EUR	187 140	0.53
<b>IMOBILIÁRIO</b>						<b>4 739 350</b>	<b>13.48</b>
<b>IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO</b>						<b>4 739 350</b>	<b>13.48</b>
CXG IMOBILIARIO	PTYMESHE0009	182 714.00	4.13		EUR	753 750	2.14
FUNDIESTAMO I	PTGFIBIM0004	58.00	1 181.58		EUR	68 532	0.19
Fundimo	PTYCXTHM0007	493 346.00	7.94		EUR	3 917 069	11.14
<b>LIQUIDEZ</b>						<b>2 785 539</b>	<b>7.92</b>
<b>TOTAL</b>						<b>35 152 464</b>	<b>100.00</b>

## Saldos de Unidades de Participação

	Peso (%)	Valor (EUR)
Valor (EUR)	100.00	35 152 463.730000
Quantidade		5 049 556.085219
Cotação 2021-08-01 (EUR)		6.961500

## 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