

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

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
AÇÕES						11 677 872	32.18
AÇÕES EUA						0	0.00
AÇÕES EUA - INV. DIRETO						0	0.00
ESH2 S&P500 03/22	91004070051	2.00	4 762.00		USD	0	0.00
AÇÕES ÁSIA						358 913	0.99
AÇÕES ÁSIA - INV. INDIRETO						358 913	0.99
X MSCI JAPAN EUR	LU0659580079	13 940.00	25.75		EUR	358 913	0.99
AÇÕES EUROPEIAS						11 318 958	31.19
AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO						2 567 393	7.07
EDP Renováveis	ES0127797019	1 192.00	21.90		EUR	26 105	0.07
VGH2 EUR EUX 03/22	DE000C47BQN9	13.00	4 287.50		EUR	0	0.00
BMW	DE0005190003	216.00	88.49		EUR	19 114	0.05
SIEMENS	DE0007236101	667.00	152.68		EUR	101 838	0.28
ALLIANZ	DE0008404005	174.00	207.65		EUR	36 131	0.10
BASF	DE000BASF111	524.00	61.78		EUR	32 373	0.09
BAYER AG	DE000BAY0017	1 080.00	47.00		EUR	50 760	0.14
RWE-RHEINISCH WEST..	DE0007037129	282.00	35.72		EUR	10 073	0.03
ADIDAS- SALOMON AG	DE000A1EWWWO	99.00	253.20		EUR	25 067	0.07
SAP SE	DE0007164600	467.00	124.90		EUR	58 328	0.16
DEUTSCHE TELEKOM	DE0005557508	2 996.00	16.30		EUR	48 835	0.13
DAIMLER CHRYSLER	DE0007100000	692.00	67.59		EUR	46 772	0.13
INFINEON TECHNOLOGIE	DE0006231004	317.00	40.76		EUR	12 921	0.04
DEUTSCHE POST	DE0005552004	1 323.00	56.54		EUR	74 802	0.21
DEUTSCHE BOERSE AG	DE0005810055	166.00	147.10		EUR	24 419	0.07
VOLKSWAGEN AG-PREF.	DE0007664039	137.00	177.48		EUR	24 315	0.07
FRESENIUS SE&CO KGAA	DE0005785604	411.00	35.40		EUR	14 549	0.04
SIEMENS HEALTHIN	DE000SHL1006	443.00	65.82		EUR	29 158	0.08
DANONE	FR0000120644	496.00	54.59		EUR	27 077	0.07
AXA-UAP	FR0000120628	492.00	26.19		EUR	12 883	0.04
PERNOD RICARD	FR0000120693	230.00	211.50		EUR	48 645	0.13
TotalEnergies SE	FR0000120271	1 137.00	44.63		EUR	50 744	0.14
L OREAL	FR0000120321	230.00	416.95		EUR	95 899	0.26
Kering	FR0000121485	53.00	706.90		EUR	37 466	0.10
BNP	FR0000131104	1 126.00	60.77		EUR	68 427	0.19
AIR LIQUIDE	FR0000120073	364.00	153.32		EUR	55 808	0.15
SCHNEIDER	FR0000121972	257.00	172.46		EUR	44 322	0.12
L.V.M.H.	FR0000121014	197.00	727.00		EUR	143 219	0.39
MICHELIN	FR0000121261	177.00	144.15		EUR	25 515	0.07



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA VALOR
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	551.00	61.87		EUR	34 090	0.09
SOCIETE GENERALE	FR0000130809	1 450.00	30.21		EUR	43 797	0.12
CAP GEMINI SOGETI	FR0000125338	196.00	215.50		EUR	42 238	0.12
EssilorLuxottica	FR0000121667	176.00	187.24		EUR	32 954	0.09
GLE ENTREP. VINCI	FR0000125486	395.00	92.91		EUR	36 699	0.10
SANOFI SYNHLABO	FR0000120578	628.00	88.58		EUR	55 628	0.15
AIRBUS SE	NL0000235190	462.00	112.36		EUR	51 910	0.14
SAFRAN SA	FR0000073272	116.00	107.66		EUR	12 489	0.03
HERMES INTERNACIONAL	FR0000052292	22.00	1 536.00		EUR	33 792	0.09
TELEPERFORMANCE	FR0000051807	50.00	392.00		EUR	19 600	0.05
RECKITT BENCKISER	GB00B24CGK77	195.00	63.42		GBP	14 718	0.04
ANGLO AMERICAN PLC	GB00B1XZS820	388.00	30.16		GBP	13 927	0.04
OCADO GROUP PLC	GB00B3MBS747	732.00	16.78		GBP	14 618	0.04
AMADEUS HOLDING SA	ES0109067019	501.00	59.64		EUR	29 880	0.08
TELEFONICA	ES0178430E18	5 926.00	3.85		EUR	22 827	0.06
BCO SANTANDER C.HISP	ES0113900J37	3 985.00	2.94		EUR	11 718	0.03
IBERDROLA	ES0144580Y14	3 955.00	10.41		EUR	41 172	0.11
FERROVIAL	ES0118900010	405.00	27.56		EUR	11 162	0.03
INDITEX	ES0148396007	1 078.00	28.53		EUR	30 755	0.08
Siemens Gamesa R	ES0143416115	325.00	21.07		EUR	6 848	0.02
GENERALI ASSUC.	IT0000062072	967.00	18.63		EUR	18 015	0.05
UNICREDITO ITALIANO	IT0005239360	4 189.00	13.54		EUR	56 736	0.16
ENI SPA	IT0003132476	555.00	12.22		EUR	6 782	0.02
ENEL	IT0003128367	5 252.00	7.05		EUR	37 006	0.10
ESSITY AKTIEBO-B	SE0009922164	547.00	295.40		SEK	15 708	0.04
ING GROEP NV	NL0011821202	5 060.00	12.24		EUR	61 945	0.17
ASML NA	NL0010273215	309.00	706.70		EUR	218 370	0.60
AKZO NOBEL NV NLG20	NL0013267909	198.00	96.50		EUR	19 107	0.05
DSM NV	NL0000009827	179.00	198.00		EUR	35 442	0.10
STELLANTIS NV	NL00150001Q9	2 895.00	16.69		EUR	48 306	0.13
ASR NEDERLAND NV	NL0011872643	571.00	40.50		EUR	23 126	0.06
Prosus NV	NL0013654783	381.00	73.53		EUR	28 015	0.08
Universal Music Grp	NL0015000IY2	771.00	24.78		EUR	19 105	0.05
NOKIA A	FI0009000681	6 916.00	5.57		EUR	38 550	0.11
SAMPO OYJ-A SHS	FI0009003305	700.00	44.06		EUR	30 842	0.08
Neste Oyj	FI0009013296	231.00	43.36		EUR	10 016	0.03
ANHEUSER-BUSCH INB	BE0974293251	623.00	53.17		EUR	33 125	0.09
ERST BK DER OEST.SPA	AT0000652011	880.00	41.35		EUR	36 388	0.10
CRH ORD	IE0001827041	525.00	46.52		EUR	24 423	0.07
AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO						8 751 566	24.11

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA VALOR
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	1 091.32	2 811.49		EUR	3 068 230	8.45
SCHRO-EU EQ-IZE	LU2004793787	54 485.44	57.15		EUR	3 113 750	8.58
EU STEQ-SI/ANPFE	LU1799977381	8 919.11	144.81		EUR	1 291 576	3.56
AB I-EUZ EQ S1E	LU0528104002	35 148.79	36.36		EUR	1 278 010	3.52
OBRIGAÇÕES						14 858 379	40.94
OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO						14 858 379	40.94
OBRIGAÇÕES GOVERNOS						6 561 465	18.08
DBR 1.5% 02/2023	DE0001102309	525 000.00	102.46%	6 904	EUR	544 835	1.50
DBR 0.5% 08/27	DE0001102424	300 000.00	105.25%	571	EUR	316 321	0.87
DBR 0.25% 02/2029	DE0001102465	310 000.00	104.36%	679	EUR	324 183	0.89
DBR 0% 08/2050	DE0001102481	202 000.00	95.13%		EUR	192 161	0.53
BKO 0% 09/2022	DE0001104818	145 000.00	100.46%		EUR	145 668	0.40
FRTR 4.25% 10/2023	FR0010466938	853 000.00	108.88%	6 754	EUR	935 517	2.58
FRTR 0.25% 11/26	FR0013200813	1 641 000.00	102.75%	416	EUR	1 686 461	4.65
SPGB 3.45% 07/66	ES00000128E2	88 000.00	150.33%	1 289	EUR	133 581	0.37
SPGB 0.45% 10/22	ES0000012A97	774 000.00	100.94%	592	EUR	781 898	2.15
SPGB 0.5% 10/2031	ES0000012I32	464 000.00	99.38%	394	EUR	461 531	1.27
BTPS 1,7% 09/2051	IT0005425233	300 000.00	93.65%	1 719	EUR	282 681	0.78
RAGB 0.75% 10/26	AT0000A1K9C8	124 000.00	105.26%	186	EUR	130 707	0.36
IRISH 0% 10/22	IE00BDHDPQ37	35 000.00	100.43%		EUR	35 151	0.10
KOREA 0% 09/2025	XS2226969686	100 000.00	100.30%		EUR	100 298	0.28
KFW 0% 04/2024	DE000A2LQSP7	245 000.00	101.20%		EUR	247 935	0.68
CCTS Float 07/2023	IT0005185456	200 000.00	100.89%	177	EUR	201 957	0.56
EU 0% 07/2026	EU000A3KTGV8	40 000.00	101.45%		EUR	40 579	0.11
OBRIGAÇÕES CRÉDITO						8 296 915	22.86
DAIGR Float 07/24	DE000A2GSCY9	300 000.00	100.78%		EUR	302 325	0.83
PBBGR Float 07/28/23	DE000A2YNV36	200 000.00	100.87%	126	EUR	201 860	0.56
DB Float 05/2022	DE000DL19TQ2	300 000.00	100.21%	91	EUR	300 712	0.83
BNP Float 09/22	XS1584041252	100 000.00	100.53%	7	EUR	100 541	0.28
SOCGEN Float 04/22	XS1586146851	200 000.00	100.18%	157	EUR	200 525	0.55
ACAFP Float 04/22	XS1598861588	100 000.00	100.21%	51	EUR	100 264	0.28
BNP Float 06/24	XS1626933102	200 000.00	101.32%	26	EUR	202 668	0.56
RENAUL Float 03/2022	FR0013260486	200 000.00	100.08%	8	EUR	200 158	0.55
GFCFP Float 06/22	FR0013266343	200 000.00	100.15%		EUR	200 296	0.55
RENAULT Float 11/24	FR0013292687	150 000.00	100.20%	1	EUR	150 295	0.41
CAFP Float 06/22	FR0013342664	100 000.00	100.08%	1	EUR	100 081	0.28
ACAFP Float 01/2022	FR0013396777	100 000.00	100.02%		EUR	100 021	0.28
CAFP Float 09/2023	FR0013446580	100 000.00	100.55%	3	EUR	100 557	0.28
LLOYDS Float 06/2024	XS1633845158	200 000.00	101.45%	12	EUR	202 908	0.56
HSBC Float 10/23	XS1681855539	200 000.00	100.29%		EUR	200 578	0.55



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA VALOR
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 (%)
BACR Float 05/2026	XS2342059784	300 000.00	101.94%	180	EUR	306 000	0.84
IBESM Float 02/24	XS1564443759	200 000.00	100.74%	24	EUR	201 506	0.56
BBVASM Float 03/23	XS1788584321	200 000.00	100.48%	4	EUR	200 964	0.55
AMSSM Float 03/22	XS1878190757	200 000.00	100.00%		EUR	200 004	0.55
SANTAN Float 03/23	XS1689234570	200 000.00	100.69%	4	EUR	201 376	0.55
ISPIM Float 04/22	XS1599167589	200 000.00	100.23%	165	EUR	200 623	0.55
BACRED Float 05/22	XS1615501837	200 000.00	100.22%	59	EUR	200 489	0.55
WFC Float 01/22	XS1558022866	100 000.00	100.03%		EUR	100 034	0.28
BAC Float 05/23	XS1602557495	200 000.00	100.21%	69	EUR	200 491	0.55
F Float 12/24	XS1729872736	200 000.00	98.45%	22	EUR	196 914	0.54
C Float 03/23	XS1795253134	200 000.00	100.50%		EUR	201 000	0.55
BAC FLOAT 04/24	XS1811433983	200 000.00	100.51%	57	EUR	201 073	0.55
T Float 09/23	XS1907118464	200 000.00	100.98%	41	EUR	202 007	0.56
GS Float 04/2023	XS2107332483	200 000.00	100.06%	1	EUR	200 111	0.55
BAC Float 09/2026	XS2387929834	200 000.00	101.68%	23	EUR	203 375	0.56
DT Float 12/2022	XS1828028677	200 000.00	100.39%		EUR	200 770	0.55
BAYNGR Float 06/22	XS1840614736	200 000.00	100.17%		EUR	200 346	0.55
INTNED Float 09/23	XS1882544205	200 000.00	101.19%	17	EUR	202 405	0.56
VW Float 11/24	XS1910947941	200 000.00	103.48%	252	EUR	207 202	0.57
ANNGR Float 12/2022	DE000A19X793	200 000.00	100.31%		EUR	200 618	0.55
JYBC Float 12/22	XS1726323436	100 000.00	100.41%	3	EUR	100 415	0.28
KBCBB Float 11/22	BE0002281500	100 000.00	100.42%		EUR	100 415	0.28
ABIBB Float 04/24	BE6301509012	200 000.00	100.61%		EUR	201 218	0.55
DLTAS 2008-1 A	XS0390756285	23 687.09	99.97%		EUR	23 680	0.07
DHR Float 06/22	XS1637162246	200 000.00	100.17%		EUR	200 344	0.55
SUMIBK Float 06/22	XS1621087359	200 000.00	100.19%		EUR	200 374	0.55
MIZUHO Float 04/23	XS1801906279	200 000.00	100.52%		EUR	201 034	0.55
TACHEM Float 11/22	XS1843449809	200 000.00	100.81%	119	EUR	201 739	0.56
MUFG Float 05/2023	XS1828132735	200 000.00	100.55%		EUR	201 098	0.55
BMO Float 03/22	XS1791326728	100 000.00	100.10%		EUR	100 102	0.28
GS Float 07/2022	XS1173867323	75 000.00	100.45%	63	EUR	75 397	0.21
ALTERNATIVOS						304 522	0.84
CAIXA PRIVATE EQUITY	PTYME4LE0005	16 936.00	6.29		EUR	106 580	0.29
CAIXA INFRAESTRUTURA	PTYME7LE0002	24 958.00	7.93		EUR	197 942	0.55
IMOBILIÁRIO						4 869 798	13.42
IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO						4 869 798	13.42
CXG IMOBILIARIO	PTYMESHE0009	182 714.00	4.39		EUR	801 365	2.21
FUNDIESTAMO I	PTGFIBIM0004	58.00	1 161.17		EUR	67 348	0.19
Fundimo	PTYCXTHM0007	499 530.00	8.01		EUR	4 001 085	11.02
LIQUIDEZ						4 581 402	12.62



CGD Pensões

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

TOTAL	36 291 973	100.00
--------------	-------------------	---------------

Saldos de Unidades de Participação

	Peso (%)	Valor (EUR)
Valor (EUR)	100.00	36 291 973.140000
Quantidade		5 159 286.706459
Cotação 2022-01-01 (EUR)		7.034300

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