

CGD PENSÕES - SGFP,SA
 AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
 FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
 Composição da Carteira em: 2022-02-28

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
AÇÕES						12 244 233	10.76
AÇÕES EUA						0	0.00
AÇÕES EUA - INV. DIRETO						0	0.00
ESH2 S&P500 03/22	91004070051	6.00	4 348.25		USD	0	0.00
AÇÕES ÁSIA						1 113 384	0.98
AÇÕES ÁSIA - INV. INDIRETO						1 113 384	0.98
X MSCI JAPAN EUR	LU0659580079	45 790.00	24.32		EUR	1 113 384	0.98
AÇÕES EUROPEIAS						11 130 849	9.78
AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO						3 641 851	3.20
EDP Renováveis	ES0127797019	1 782.00	21.72		EUR	38 705	0.03
VGH2 EUR EUX 03/22	DE000C47BQN9	28.00	3 878.50		EUR	0	0.00
BMW	DE0005190003	335.00	86.56		EUR	28 998	0.03
SIEMENS	DE0007236101	1 037.00	126.66		EUR	131 346	0.12
ALLIANZ	DE0008404005	270.00	203.30		EUR	54 891	0.05
BASF	DE000BASF111	946.00	59.25		EUR	56 051	0.05
BAYER AG	DE000BAY0017	1 678.00	51.51		EUR	86 434	0.08
RWE-RHEINISCH WEST..	DE0007037129	438.00	41.49		EUR	18 173	0.02
ADIDAS- SALOMON AG	DE000A1EWWWO	153.00	212.05		EUR	32 444	0.03
SAP SE	DE0007164600	727.00	101.32		EUR	73 660	0.06
DEUTSCHE TELEKOM	DE0005557508	4 662.00	16.03		EUR	74 732	0.07
Mercedes-Benz Grp AG	DE0007100000	1 073.00	70.17		EUR	75 292	0.07
INFINEON TECHNOLOGIE	DE0006231004	493.00	30.75		EUR	15 157	0.01
DEUTSCHE POST	DE0005552004	2 050.00	45.16		EUR	92 578	0.08
DEUTSCHE BOERSE AG	DE0005810055	259.00	152.70		EUR	39 549	0.03
VOLKSWAGEN AG-PREF.	DE0007664039	213.00	178.04		EUR	37 923	0.03
FRESENIUS SE&CO KGAA	DE0005785604	639.00	31.27		EUR	19 978	0.02
SIEMENS HEALTHIN	DE000SHL1006	688.00	57.48		EUR	39 546	0.03
DANONE	FR0000120644	767.00	54.31		EUR	41 656	0.04
AXA-UAP	FR0000120628	765.00	24.28		EUR	18 570	0.02
PERNOD RICARD	FR0000120693	355.00	195.65		EUR	69 456	0.06
TotalEnergies SE	FR0000120271	2 342.00	45.59		EUR	106 772	0.09
L OREAL	FR0000120321	355.00	355.00		EUR	126 025	0.11
Kering	FR0000121485	82.00	637.10		EUR	52 242	0.05
BNP	FR0000131104	1 753.00	52.51		EUR	92 050	0.08
AIR LIQUIDE	FR0000120073	646.00	148.70		EUR	96 060	0.08
SCHNEIDER	FR0000121972	400.00	139.78		EUR	55 912	0.05
L.V.M.H.	FR0000121014	307.00	659.90		EUR	202 589	0.18
MICHELIN	FR0000121261	276.00	124.00		EUR	34 224	0.03



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2022-02-28

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	55.95		EUR	47 725	0.04
SOCIETE GENERALE	FR0000130809	2 256.00	25.64		EUR	57 844	0.05
CAP GEMINI SOGETI	FR0000125338	306.00	188.30		EUR	57 620	0.05
EssilorLuxottica	FR0000121667	274.00	156.72		EUR	42 941	0.04
GLE ENTREP. VINCI	FR0000125486	610.00	94.52		EUR	57 657	0.05
SANOFI SYNHLABO	FR0000120578	976.00	93.47		EUR	91 227	0.08
AIRBUS SE	NL0000235190	729.00	114.90		EUR	83 762	0.07
SAFRAN SA	FR0000073272	177.00	114.70		EUR	20 302	0.02
HERMES INTERNACIONAL	FR0000052292	35.00	1 242.00		EUR	43 470	0.04
TELEPERFORMANCE	FR0000051807	78.00	331.90		EUR	25 888	0.02
RECKITT BENCKISER	GB00B24CGK77	369.00	63.21		GBP	27 883	0.02
OCADO GROUP PLC	GB00B3MBS747	1 134.00	13.73		GBP	18 613	0.02
GLENCORE PLC	JE00B4T3BW64	3 918.00	4.42		GBP	20 709	0.02
AMADEUS HOLDING SA	ES0109067019	780.00	59.94		EUR	46 753	0.04
TELEFONICA	ES0178430E18	9 222.00	4.28		EUR	39 433	0.03
BCO SANTANDER C.HISP	ES0113900J37	6 201.00	2.98		EUR	18 507	0.02
IBERDROLA	ES0144580Y14	6 242.00	10.18		EUR	63 544	0.06
FERROVIAL	ES0118900010	627.00	24.42		EUR	15 311	0.01
INDITEX	ES0148396007	1 672.00	23.60		EUR	39 459	0.03
Siemens Gamesa R	ES0143416115	505.00	20.73		EUR	10 469	0.01
GENERALI ASSUC.	IT0000062072	1 506.00	17.73		EUR	26 701	0.02
UNICREDITO ITALIANO	IT0005239360	6 518.00	11.39		EUR	74 227	0.07
ENI SPA	IT0003132476	1 481.00	13.83		EUR	20 485	0.02
ENEL	IT0003128367	8 341.00	6.60		EUR	55 042	0.05
ESSITY AKTIEBO-B	SE0009922164	847.00	244.70		SEK	19 542	0.02
ING GROEP NV	NL0011821202	7 874.00	10.50		EUR	82 661	0.07
ASML NA	NL0010273215	481.00	598.90		EUR	288 071	0.25
AKZO NOBEL NV NLG20	NL0013267909	208.00	85.00		EUR	17 680	0.02
DSM NV	NL0000009827	112.00	167.30		EUR	18 738	0.02
STELLANTIS NV	NL00150001Q9	4 487.00	16.37		EUR	73 452	0.06
ASR NEDERLAND NV	NL0011872643	889.00	38.53		EUR	34 253	0.03
Prosus NV	NL0013654783	592.00	55.42		EUR	32 809	0.03
Universal Music Grp	NL0015000IY2	1 200.00	20.33		EUR	24 396	0.02
NOKIA A	FI0009000681	10 763.00	4.84		EUR	52 066	0.05
SAMPO OYJ-A SHS	FI0009003305	1 089.00	42.36		EUR	46 130	0.04
ANHEUSER-BUSCH INB	BE0974293251	966.00	55.14		EUR	53 265	0.05
ERST BK DER OEST.SPA	AT0000652011	1 370.00	31.99		EUR	43 826	0.04
CRH ORD	IE0001827041	945.00	40.61		EUR	38 376	0.03
AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO						7 488 998	6.58
ALLIANZ RCM EUR EQTY	LU0852482198	1 119.35	2 331.50		EUR	2 609 772	2.29

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2022-02-28

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
SCHRO-EU EQ-IZE	LU2004793787	51 160.86	52.52		EUR	2 686 733	2.36
EU STEQ-SI/ANPFE	LU1799977381	8 274.29	130.86		EUR	1 082 773	0.95
AB I-EUZ EQ S1E	LU0528104002	32 514.50	34.13		EUR	1 109 720	0.97
OBRIGAÇÕES						74 185 927	65.18
OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO						74 185 927	65.18
OBRIGAÇÕES GOVERNOS						17 871 055	15.70
DBR 1.5% 02/2023	DE0001102309	1 354 000.00	102.03%	779	EUR	1 382 238	1.21
DBR 0.5% 08/27	DE0001102424	1 800 000.00	103.55%	4 882	EUR	1 868 854	1.64
DBR 0.25% 02/2029	DE0001102465	1 500 000.00	102.22%	144	EUR	1 533 474	1.35
DBR 0% 08/2050	DE0001102481	335 000.00	89.72%		EUR	300 562	0.26
BKO 0% 09/2022	DE0001104818	509 000.00	100.34%		EUR	510 741	0.45
DBR 0% 05/2036	DE0001102549	650 000.00	96.13%		EUR	624 819	0.55
FRTR 4.25% 10/2023	FR0010466938	289 000.00	107.99%	4 274	EUR	316 356	0.28
FRTR 0.25% 11/26	FR0013200813	4 354 000.00	101.11%	2 863	EUR	4 405 323	3.87
FRTR 0.75% 05/2053	FR0014004J31	100 000.00	88.25%	575	EUR	88 824	0.08
SPGB 1.95% 07/2030	ES00000127A2	275 000.00	109.03%	3 144	EUR	302 977	0.27
SPGB 0.45% 10/22	ES0000012A97	1 417 000.00	100.66%	2 114	EUR	1 428 409	1.25
SPGB 1.9% 10/2052	ES0000012K46	840 000.00	100.48%	568	EUR	844 567	0.74
BTPS 1,7% 09/2051	IT0005425233	800 000.00	86.74%	6 800	EUR	700 736	0.62
RAGB 0% 07/2023	AT0000A1PE50	1 084 000.00	100.66%		EUR	1 091 187	0.96
IRISH 0% 10/22	IE00BDHDPQ37	337 000.00	100.35%		EUR	338 180	0.30
KOREA 0% 09/2025	XS2226969686	200 000.00	98.38%		EUR	196 760	0.17
KFW 0% 04/2024	DE000A2LQSP7	422 000.00	100.56%		EUR	424 367	0.37
CCTS Float 07/2023	IT0005185456	1 300 000.00	101.03%	270	EUR	1 313 647	1.15
EU 0% 07/2026	EU000A3KTGV8	200 000.00	99.52%		EUR	199 034	0.17
OBRIGAÇÕES CRÉDITO						56 314 872	49.48
DAIGR Float 07/24	DE000A2GSCY9	600 000.00	100.30%		EUR	601 788	0.53
PBBGR Float 07/28/23	DE000A2YNV36	1 000 000.00	100.70%	308	EUR	1 007 318	0.88
DB Float 05/2022	DE000DL19TQ2	2 400 000.00	100.12%	246	EUR	2 403 102	2.11
ACAFP Float 04/22	XS1598861588	1 500 000.00	100.08%	403	EUR	1 501 558	1.32
SOCGEN Float 05/24	XS1616341829	1 600 000.00	100.63%	85	EUR	1 610 197	1.41
BNP Float 06/24	XS1626933102	1 000 000.00	100.62%	436	EUR	1 006 676	0.88
RENAUL Float 03/2022	FR0013260486	400 000.00	100.00%	70	EUR	400 062	0.35
GFCFP Float 06/22	FR0013266343	500 000.00	100.08%		EUR	500 395	0.44
RENAULT Float 11/24	FR0013292687	1 200 000.00	99.65%	19	EUR	1 195 759	1.05
BNP Float 05/23	XS1823532996	300 000.00	100.36%	5	EUR	301 094	0.26
CAFP Float 09/2023	FR0013446580	1 900 000.00	100.38%	268	EUR	1 907 431	1.68
LLOYDS Float 06/2024	XS1633845158	1 000 000.00	100.83%	387	EUR	1 008 637	0.89
HSBC Float 10/23	XS1681855539	1 500 000.00	100.12%		EUR	1 501 755	1.32
BACR Float 05/2026	XS2342059784	2 000 000.00	100.52%	393	EUR	2 010 753	1.77



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2022-02-28

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	100.59%	1 599	EUR	2 114 052	1.86
IBESM Float 02/24	XS1564443759	1 200 000.00	100.30%	38	EUR	1 203 626	1.06
SANTAN Float 03/22	XS1578916261	1 000 000.00	100.04%	854	EUR	1 001 284	0.88
AMSSM Float 03/22	XS1878190757	700 000.00	99.99%		EUR	699 958	0.61
SANTAN Float 03/23	XS1689234570	500 000.00	100.48%	143	EUR	502 548	0.44
ISPIM Float 04/22	XS1599167589	1 000 000.00	100.07%	444	EUR	1 001 114	0.88
BACRED Float 05/22	XS1615501837	1 000 000.00	100.10%	84	EUR	1 001 124	0.88
BAC Float 05/23	XS1602557495	350 000.00	100.07%	57	EUR	350 284	0.31
GS Float 09/23	XS1691349523	800 000.00	99.96%	41	EUR	799 705	0.70
F Float 12/24	XS1729872736	550 000.00	96.15%	179	EUR	528 998	0.46
F Float 12/22	XS1767930826	300 000.00	99.28%		EUR	297 828	0.26
C Float 03/23	XS1795253134	1 650 000.00	100.28%		EUR	1 654 554	1.45
GM Float 03/22	XS1792505197	300 000.00	99.99%		EUR	299 970	0.26
BAC FLOAT 04/24	XS1811433983	1 400 000.00	100.02%	201	EUR	1 400 523	1.23
T Float 09/23	XS1907118464	1 500 000.00	100.71%	1 009	EUR	1 511 689	1.33
GS Float 04/2023	XS2107332483	500 000.00	99.98%		EUR	499 910	0.44
BAC Float 09/2026	XS2387929834	2 200 000.00	100.24%	1 737	EUR	2 206 995	1.94
CS Float 01/2026	CH0591979635	2 200 000.00	99.54%	1 148	EUR	2 190 918	1.92
DAIGR Float 05/22	DE000A19HBM3	500 000.00	100.04%		EUR	500 195	0.44
BAYNGR Float 06/22	XS1840614736	1 500 000.00	100.08%		EUR	1 501 200	1.32
INTNED Float 09/23	XS1882544205	600 000.00	100.84%	309	EUR	605 331	0.53
VW Float 11/24	XS1910947941	1 600 000.00	102.87%	597	EUR	1 646 437	1.45
ANNGR Float 12/2022	DE000A19X793	1 600 000.00	100.19%		EUR	1 603 008	1.41
NYKRE Float 06/22	DK0009514473	700 000.00	100.08%		EUR	700 539	0.62
NYKRE Flt. 01/24	DK0009520520	300 000.00	100.38%		EUR	301 153	0.26
SBBBSS FLT 02/24	XS2438632874	1 000 000.00	97.20%	1	EUR	972 001	0.85
KBCBB Float 11/22	BE0002281500	1 600 000.00	100.18%	5	EUR	1 602 917	1.41
ABIBB Float 04/24	BE6301509012	1 600 000.00	100.30%		EUR	1 604 864	1.41
DLTAS 2008-1 A	XS0390756285	180 482.57	99.89%		EUR	180 278	0.16
DHR Float 06/22	XS1637162246	950 000.00	100.08%		EUR	950 741	0.84
DE FLOAT 10/22	XS1692846790	2 100 000.00	100.20%		EUR	2 104 137	1.85
SUMIBK Float 06/22	XS1621087359	1 500 000.00	100.08%		EUR	1 501 200	1.32
TACHEM Float 11/22	XS1843449809	1 600 000.00	100.58%	203	EUR	1 609 435	1.41
MUFG Float 05/2023	XS1828132735	1 400 000.00	100.40%	1	EUR	1 405 601	1.23
CBAAU Float 03/2023	XS1789454326	700 000.00	100.32%		EUR	702 254	0.62
GS Float 07/2022	XS1173867323	600 000.00	100.29%	259	EUR	601 975	0.53
ALTERNATIVOS						916 699	0.81
CAIXA PRIVATE EQUITY	PTYME4LE0005	40 509.00	6.38		EUR	258 524	0.23
CAIXA INFRAESTRUTURA	PTYME7LE0002	82 413.00	7.99		EUR	658 175	0.58
IMOBILIÁRIO						17 099 154	15.02

CGD PENSÕES - SGFP,SA
AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2022-02-28

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

IMOBILIÁRIO > IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO						5 113 700	4.49
REPUBLICA 35- R/C	P50040000002	8.00			EUR	5 113 700	4.49
IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO						11 985 454	10.53
CXG IMOBILIARIO	PTYMESHE0009	710 909.00	4.50		EUR	3 196 745	2.81
Fundimo	PTYCXTHM0007	1 088 472.00	8.07		EUR	8 788 214	7.72
TISHMAN ESOF	14300000004	91 579.00	0.01		EUR	495	0.00
LIQUIDEZ						9 377 103	8.24
TOTAL						113 823 116	100.00

Saldos de Unidades de Participação

	Peso (%)	Valor (EUR)
Valor (EUR)	100.00	113 823 115.790000
Quantidade		8 271 825.773329
Cotação 2022-03-01 (EUR)		13.760300

Câmbios

CHF / EUR	0.970610
DKK / EUR	0.134438
EUR / EUR	1.000000
GBP / EUR	1.195443
NOK / EUR	0.101088
SEK / EUR	0.094285
USD / EUR	0.890948