

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63 - 3º, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-04-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
AÇÕES						12 150 202	11.41
AÇÕES EUA						2 177 637	2.05
AÇÕES EUA - INV. DIRETO						32 220	0.03
ESM3 S&P500 06/23	91004070056	3.00	4 177.50		USD	0	0.00
STELLANTIS NV	NL00150001Q9	2 148.00	15.00		EUR	32 220	0.03
AÇÕES EUA - INV. INDIRETO						2 145 417	2.02
TROWE ROWE PRICE QR	LU1136108674	39 636.67	25.82		EUR	1 023 419	0.96
MORGAN-US AD-Z\$	LU0360484686	4 898.74	92.11		USD	408 754	0.38
ISHARES S&P500 VALUE	US4642874089	5 113.00	153.99		USD	713 245	0.67
AÇÕES ÁSIA						1 694 023	1.59
AÇÕES ÁSIA - INV. INDIRETO						1 694 023	1.59
TROWEP-JP E-I2€A	LU2444288430	120 501.55	9.25		EUR	1 114 639	1.05
X MSCI JAPAN EUR	LU0659580079	21 469.00	26.99		EUR	579 384	0.54
AÇÕES EUROPEIAS						7 227 396	6.79
AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO						2 041 682	1.92
EDP Renováveis	ES0127797019	942.00	20.16		EUR	18 991	0.02
VGM3 EUR EUX 06/23	DE000C6EV128	14.00	4 323.00		EUR	0	0.00
BMW	DE0005190003	177.00	101.44		EUR	17 955	0.02
COMMERZBANK	DE000CBK1001	1 302.00	10.07		EUR	13 105	0.01
SIEMENS	DE0007236101	498.00	148.90		EUR	74 152	0.07
ALLIANZ	DE0008404005	139.00	227.45		EUR	31 616	0.03
BASF	DE000BASF111	645.00	46.85		EUR	30 218	0.03
BAYER AG	DE000BAY0017	583.00	59.76		EUR	34 840	0.03
RWE-RHEINISCH WEST..	DE0007037129	356.00	42.55		EUR	15 148	0.01
ADIDAS- SALOMON AG	DE000A1EWWW0	152.00	159.44		EUR	24 235	0.02
MERCK KGAA	DE0006599905	76.00	162.55		EUR	12 354	0.01
SAP SE	DE0007164600	414.00	122.86		EUR	50 864	0.05
DEUTSCHE TELEKOM	DE0005557508	2 416.00	21.88		EUR	52 862	0.05
Mercedes-Benz Grp AG	DE0007100000	494.00	70.58		EUR	34 867	0.03
INFINEON TECHNOLOGIE	DE0006231004	319.00	32.91		EUR	10 497	0.01
DEUTSCHE POST	DE0005552004	645.00	43.52		EUR	28 070	0.03
DEUTSCHE BOERSE AG	DE0005810055	85.00	172.90		EUR	14 697	0.01
VONOVIA SE	DE000A1ML7J1	797.00	19.63		EUR	15 641	0.01
DANONE	FR0000120644	232.00	59.99		EUR	13 918	0.01
AXA-UAP	FR0000120628	1 390.00	29.57		EUR	41 102	0.04
CARREFOUR	FR0000120172	684.00	18.86		EUR	12 900	0.01
PERNOD RICARD	FR0000120693	152.00	209.40		EUR	31 829	0.03
TotalEnergies SE	FR0000120271	1 146.00	57.94		EUR	66 399	0.06

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63 - 3º, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-04-30

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	132.00	432.75		EUR	57 123	0.05
Kering	FR0000121485	22.00	579.70		EUR	12 753	0.01
BNP	FR0000131104	341.00	58.59		EUR	19 979	0.02
AIR LIQUIDE	FR0000120073	315.00	163.18		EUR	51 402	0.05
SCHNEIDER	FR0000121972	219.00	157.82		EUR	34 563	0.03
L.V.M.H.	FR0000121014	156.00	871.00		EUR	135 876	0.13
MICHELIN	FR001400AJ45	616.00	28.83		EUR	17 759	0.02
SAINT-GOBAIN	FR0000125007	525.00	52.42		EUR	27 521	0.03
THOMSON	FR0000121329	114.00	138.40		EUR	15 778	0.01
SOCIETE GENERALE	FR0000130809	1 228.00	22.03		EUR	27 047	0.03
CAP GEMINI SOGETI	FR0000125338	177.00	164.90		EUR	29 187	0.03
EssilorLuxottica	FR0000121667	142.00	179.40		EUR	25 475	0.02
GLE ENTREP. VINCI	FR0000125486	302.00	112.20		EUR	33 884	0.03
SANOFI SYNHLABO	FR0000120578	539.00	100.00		EUR	53 900	0.05
VEOLIA ENVIRONEMENT	FR0000124141	472.00	28.69		EUR	13 542	0.01
AIRBUS SE	NL0000235190	406.00	127.14		EUR	51 619	0.05
SAFRAN SA	FR0000073272	89.00	140.94		EUR	12 544	0.01
HERMES INTERNACIONAL	FR0000052292	23.00	1 966.80		EUR	45 236	0.04
TELEPERFORMANCE	FR0000051807	56.00	180.80		EUR	10 125	0.01
RECKITT BENCKISER	GB00B24CGK77	183.00	64.30		GBP	13 410	0.01
OCADO GROUP PLC	GB00B3MBS747	1 628.00	5.05		GBP	9 373	0.01
GLENCORE PLC	JE00B4T3BW64	1 768.00	4.69		GBP	9 450	0.01
ASHTREAD GROUP PLC	GB0000536739	165.00	45.77		GBP	8 606	0.01
AMADEUS HOLDING SA	ES0109067019	412.00	63.74		EUR	26 261	0.02
SHELL PLC-NEW	GB00BP6MXD84	341.00	28.09		EUR	9 579	0.01
TELEFONICA	ES0178430E18	4 301.00	4.13		EUR	17 742	0.02
BCO SANTANDER C.HISP	ES0113900J37	10 692.00	3.19		EUR	34 070	0.03
FERROVIAL	ES0118900010	373.00	28.43		EUR	10 604	0.01
INDITEX	ES0148396007	809.00	31.16		EUR	25 208	0.02
BANCO SABADELL SA	ES0113860A34	14 574.00	0.94		EUR	13 770	0.01
CAIXABANK SA	ES0140609019	6 462.00	3.35		EUR	21 661	0.02
CELLNEX TELECOM SAU	ES0105066007	364.00	38.17		EUR	13 894	0.01
UNICREDITO ITALIANO	IT0005239360	2 194.00	17.94		EUR	39 360	0.04
ENI SPA	IT0003132476	1 719.00	13.75		EUR	23 629	0.02
ENEL	IT0003128367	6 377.00	6.20		EUR	39 531	0.04
FINECOBANK SPA	IT0000072170	1 950.00	13.73		EUR	26 774	0.03
TELE2 AB - B SHS	SE0005190238	755.00	108.95		SEK	7 270	0.01
ESSITY AKTIEBO-B	SE0009922164	369.00	310.70		SEK	10 133	0.01
C.FIN.RICHMONT	CH0210483332	86.00	146.95		CHF	12 845	0.01
KONINKLIJKE AHOLD NV	NL0011794037	483.00	31.22		EUR	15 079	0.01

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63 - 3º, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-04-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
ING GROEP NV	NL0011821202	3 152.00	11.20		EUR	35 302	0.03
KONINKLIJKE PHILIPS	NL0000009538	654.00	19.09		EUR	12 482	0.01
ASML NA	NL0010273215	254.00	573.50		EUR	145 669	0.14
DSM NV	NL0000009827	109.00	118.75		EUR	12 944	0.01
ASR NEDERLAND NV	NL0011872643	289.00	39.84		EUR	11 514	0.01
Prosus NV	NL0013654783	293.00	67.87		EUR	19 886	0.02
NOKIA A	FI0009000681	5 916.00	3.84		EUR	22 729	0.02
SAMPO OYJ-A SHS	FI0009003305	258.00	45.96		EUR	11 858	0.01
Neste Oyj	FI0009013296	310.00	43.94		EUR	13 621	0.01
ERST BK DER OEST.SPA	AT0000652011	570.00	32.91		EUR	18 759	0.02
CRH ORD	IE0001827041	619.00	43.78		EUR	27 100	0.03
AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO						5 185 714	4.87
ALLIANZ RCM EUR EQTY	LU0852482198	557.27	2 238.25		EUR	1 247 303	1.17
SCHRO-EU EQ-IZE	LU2004793787	24 979.18	53.90		EUR	1 346 325	1.26
EU STEQ-SI/ANPFE	LU1799977381	4 120.01	139.35		EUR	574 124	0.54
AB I-EUZ EQ S1€	LU0528104002	11 873.44	35.44		EUR	420 795	0.40
ISHARES SMI CH	CH0008899764	3 236.00	118.84		CHF	390 875	0.37
ISHARES PLC FTSE 100	IE0005042456	90 270.00	7.73		GBP	795 414	0.75
UBS-MSCI EMU V-A	LU0446734369	10 169.00	40.41		EUR	410 878	0.39
AÇÕES EMERGENTES						1 051 145	0.99
AÇÕES EMERGENTES - INV. INDIRETO						1 051 145	0.99
GS-EMRG MKT E-I AC	LU1357028627	32 873.90	15.69		EUR	515 791	0.48
WELL-EM MK RE-S€	LU2058844833	67 080.17	7.98		EUR	535 353	0.50
OBRIGAÇÕES						72 895 478	68.48
OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO						48 056 712	45.15
OBRIGAÇÕES GOVERNOS						15 368 709	14.44
OT 2.875% 07/2026	PTOTETOE0012	258 000.00	100.54%	5 771	EUR	265 165	0.25
DBR 0.25% 02/27	DE0001102416	2 006 000.00	92.46%	1 030	EUR	1 855 758	1.74
OBL 0% 10/2024	DE0001141802	1 404 000.00	96.03%		EUR	1 348 191	1.27
FRTR 0% 03/2025	FR0013415627	1 846 000.00	94.82%		EUR	1 750 433	1.64
FRTR 0% 02/2027	FR0014003513	1 947 000.00	90.50%		EUR	1 762 113	1.66
SPGB 0% 05/2024	ES0000012H33	938 000.00	96.65%		EUR	906 586	0.85
SPGB 0% 01/2027	ES0000012J15	1 552 000.00	89.59%		EUR	1 390 499	1.31
BTPS 0% 08/2026	IT0005454241	2 671 000.00	89.55%		EUR	2 391 854	2.25
BTPS 0% 12/2024	IT0005474330	1 427 000.00	94.84%		EUR	1 353 324	1.27
NETHER 0% 01/2026	NL0015000QL2	749 000.00	93.14%		EUR	697 641	0.66
RFGB 0% 09/2026	FI4000511449	199 000.00	91.53%		EUR	182 139	0.17
BGB 1% 06/2026	BE0000337460	831 000.00	95.00%	7 126	EUR	796 535	0.75
RAGB 0.75% 10/26	AT0000A1K9C8	545 000.00	93.65%	2 161	EUR	512 565	0.48
IRISH 1% 05/2026	IE00BV8C9418	162 000.00	95.28%	1 558	EUR	155 908	0.15

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63 - 3º, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-04-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
OBRIGAÇÕES CRÉDITO						32 688 002	30.71
GALPPL 2% 01/2026	PTGALCOM0013	500 000.00	94.32%	2 904	EUR	474 484	0.45
BCPPL 1.125% 02/2027	PTBCPHOM0066	600 000.00	84.40%	1 442	EUR	507 830	0.48
FIDELI 4.25% 09/2031	PTFIDBOM0009	500 000.00	87.23%	13 914	EUR	450 069	0.42
CXGD 0.375% 09/2027	PTCGDCOM0037	700 000.00	86.77%	1 597	EUR	609 001	0.57
CRLPL 2.5% 11/2026	PTCCCAOM0000	500 000.00	87.23%	6 062	EUR	442 217	0.42
MRKGR 1.625% 06/2079	XS2011260531	500 000.00	94.57%	2 983	EUR	475 823	0.45
DB 1% 11/2025	DE000DL19VR6	500 000.00	93.70%	2 233	EUR	470 743	0.44
NRPBBGR 0.1% 02/2026	DE000A3H2ZX9	700 000.00	85.81%	169	EUR	600 804	0.56
VW 0.125% 02/2027	XS2374595044	500 000.00	86.96%	134	EUR	434 934	0.41
DBOERS 0% 02/2026	DE000A3H2457	500 000.00	91.74%		EUR	458 700	0.43
BASGR 3,125% 06/28	XS2491542374	600 000.00	99.58%	15 719	EUR	613 199	0.58
LEGGR 0.875% 11/2027	DE000A254P51	500 000.00	85.43%	1 846	EUR	428 976	0.40
ULFP 1% 02/2027	FR0013405032	600 000.00	87.92%	1 036	EUR	528 550	0.50
BPCEGP 0.625% 09/24	FR0013429073	500 000.00	95.55%	1 858	EUR	479 598	0.45
BNP 0.25% 04/2027	FR0014002X43	600 000.00	89.03%	74	EUR	534 278	0.50
BFCM 4,125% 03/2029	FR001400GGZ0	500 000.00	100.94%	2 761	EUR	507 476	0.48
ACAFP 3,875% 04/2031	FR001400HCR4	500 000.00	99.68%	582	EUR	498 982	0.47
HSBC 1.5% 12/2024	XS1917601582	500 000.00	98.67%	3 041	EUR	496 391	0.47
LLOYDS 0.375% 01/25	XS2109394077	500 000.00	94.34%	478	EUR	472 158	0.44
BPLN 3.25% PERP	XS2193661324	500 000.00	92.02%	13 935	EUR	474 055	0.45
VMUKLN 2.875% 06/25	XS2126084750	500 000.00	96.81%	5 055	EUR	489 115	0.46
NWG 1.375% 03/2027	XS2449911143	500 000.00	90.90%	1 127	EUR	455 617	0.43
CEPSA 1% 02/2025	XS1996435688	500 000.00	95.11%	1 014	EUR	476 549	0.45
BKIASM 1.125% 11/26	ES0213307061	600 000.00	90.21%	3 144	EUR	544 410	0.51
SANSCF 0.375% 01/25	XS2100690036	500 000.00	94.34%	534	EUR	472 219	0.44
BKTSM 0.625% 10/2027	ES0213679JR9	600 000.00	85.74%	2 127	EUR	516 585	0.49
CLNXSM 0.75% 11/2026	XS2300292617	500 000.00	89.21%	1 716	EUR	447 756	0.42
UCAJLN 4.5% 06/2025	ES0380907057	500 000.00	99.46%	18 801	EUR	516 091	0.48
SABSM 5.125% 11/2028	XS2553801502	500 000.00	101.22%	12 075	EUR	518 190	0.49
KUTXAB 4% 02/2028	ES0343307023	400 000.00	99.52%	3 901	EUR	401 997	0.38
SWEDA 0.25% 10/2024	XS2063261155	500 000.00	94.90%	699	EUR	475 209	0.45
SEB 4% 11/2026	XS2553798443	500 000.00	99.53%	9 479	EUR	507 119	0.48
SWEDA 4,25% 07/2028	XS2572496623	500 000.00	99.73%	6 404	EUR	505 064	0.47
ISPIM 1% 07/2024	XS2022425297	500 000.00	96.73%	4 123	EUR	487 763	0.46
UCGIM 5.85% 11/2027	XS2555420103	500 000.00	102.50%	13 383	EUR	525 888	0.49
EMR 0.375% 05/2024	XS1999902502	500 000.00	96.76%	1 767	EUR	485 557	0.46
JEF 1% 07/2024	XS2030530450	500 000.00	95.36%	3 918	EUR	480 733	0.45
BAC 1.379% 02/2025	XS1560863802	600 000.00	98.04%	1 881	EUR	590 097	0.55
MS 0.406% 10/2027	XS2338643740	600 000.00	87.60%	1 228	EUR	526 798	0.49

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63 - 3º, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-04-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
DLR 2.5% 01/2026	XS1891174341	500 000.00	93.59%	3 596	EUR	471 521	0.44
C 2.125% 09/2026	XS1107727007	500 000.00	94.43%	6 783	EUR	478 913	0.45
JPM 0.389% 02/2028	XS2123320033	500 000.00	87.10%	352	EUR	435 847	0.41
MS 4.813% 10/2028	XS2548080832	500 000.00	102.13%	12 395	EUR	523 055	0.49
VFC 4,25% 03/2029	XS2592659671	500 000.00	100.21%	3 193	EUR	504 243	0.47
MCD 4% 03/2030	XS2595418166	400 000.00	102.31%	2 404	EUR	411 632	0.39
NIBCAP 0.875% 07/25	XS2023631489	500 000.00	91.50%	3 560	EUR	461 035	0.43
ENELIM 0% 06/2024	XS2066706818	200 000.00	96.03%		EUR	192 064	0.18
REPSM 0.25% 08/2027	XS2035620710	200 000.00	87.75%	373	EUR	175 871	0.17
ANNGR 1.5% 06/2026	DE000A182VT2	500 000.00	90.97%	6 678	EUR	461 533	0.43
INTNED 1.25% 02/27	XS2443920249	500 000.00	92.27%	1 267	EUR	462 597	0.43
VW 4.25% 02/2028	XS2554488978	500 000.00	100.81%	4 366	EUR	508 426	0.48
INTNED 4.875% 11/27	XS2554746185	500 000.00	102.30%	11 219	EUR	522 694	0.49
TOYOTA 3,5% 01/2028	XS2572989817	400 000.00	99.88%	4 142	EUR	403 658	0.38
SIENFI 4,25% 04/2029	XS2601459162	300 000.00	100.19%	906	EUR	301 482	0.28
RABOBK 4,233% 04/29	XS2613658041	500 000.00	100.26%	347	EUR	501 632	0.47
NYKRE 0.75% 01/2027	DK0009526998	500 000.00	87.58%	1 038	EUR	438 948	0.41
CARLB 0.375% 06/2027	XS2191509038	400 000.00	88.15%	1 253	EUR	353 841	0.33
SYDBDC 4.75% 09/2025	XS2538445581	500 000.00	99.55%	13 860	EUR	511 620	0.48
SPOLNO 0.25% 09/2024	XS2057872595	500 000.00	94.68%	729	EUR	474 104	0.45
NESVFH 0.75% 03/2028	FI4000496286	500 000.00	87.41%	379	EUR	437 439	0.41
OPBANK 2.875% 12/25	XS2530506752	300 000.00	97.77%	3 237	EUR	296 538	0.28
RBIAS 0.25% 01/2025	XS2106056653	600 000.00	92.45%	407	EUR	555 077	0.52
DLTAS 2008-1 A	XS0390756285	24 260.49	99.89%	17	EUR	24 251	0.02
TRAGR 4.125% 11/2025	DE000A3LBGG1	500 000.00	100.39%	9 041	EUR	511 011	0.48
SUMIBK 1.413 06/27	XS1621087516	600 000.00	90.75%	7 456	EUR	551 938	0.52
TACHEM 2.25% 11/2026	XS1843449122	500 000.00	95.82%	4 962	EUR	484 042	0.45
MUFG 0.339% 07/2024	XS2028899727	600 000.00	95.82%	1 594	EUR	576 514	0.54
ERSTBK 0.375% 04/24	XS1982725159	100 000.00	97.00%	15	EUR	97 018	0.09
ANZ 1.125% 11/21/29	XS2082818951	500 000.00	93.94%	2 481	EUR	472 181	0.44
RY 0.125% 07/2024	XS2031862076	100 000.00	95.79%	97	EUR	95 886	0.09
ALVGR Var 4.75%10/23	DE000A1YCQ29	600 000.00	99.27%	14 758	EUR	610 366	0.57
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO						24 838 767	23.34
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO - GOVERNOS						24 838 767	23.34
BLUEBAY INV GR EUR G	LU0549539178	8 105.95	156.46		EUR	1 268 256	1.19
JPM F-EU GVT-I€	LU0355584201	7 678.13	110.03		EUR	844 840	0.79
ISH CORE € GOVT	IE00B4WXJJ64	134 166.00	108.30		EUR	14 529 507	13.65
XUS TREASURY €	LU1399300455	83 058.00	98.68		EUR	8 196 163	7.70
ALTERNATIVOS						926 952	0.87
CAIXA PRIVATE EQUITY	PTYME4LE0005	40 509.00	6.23		EUR	252 245	0.24

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63 - 3º, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-04-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

ALTERNATIVOS							
Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
CAIXA INFRAESTRUTURA	PTYME7LE0002	82 413.00	8.19		EUR	674 707	0.63
IMOBILIÁRIO						17 093 235	16.06
IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO						4 966 000	4.67
REPUBLICA 35- R/C	P50040000002	8.00			EUR	4 966 000	4.67
IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO						12 127 235	11.39
CXG IMOBILIARIO	PTYMESHE0009	710 909.00	4.23		EUR	3 010 629	2.83
Fundimo	PTYCXTHM0007	1 088 472.00	8.38		EUR	9 116 606	8.56
LIQUIDEZ						3 376 879	3.17
TOTAL						106 442 746	100.00

Saldos de Unidades de Participação

	Peso (%)	Valor (EUR)
Valor (EUR)	100.00	106 442 745.620000
Quantidade		8 067 541.177269
Cotação 2023-05-01 (EUR)		13.194000

Câmbios

CHF / EUR	1.016405
DKK / EUR	0.134165
EUR / EUR	1.000000
GBP / EUR	1.139614
NOK / EUR	0.085075
SEK / EUR	0.088382
USD / EUR	0.905879