

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-05-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
AÇÕES						12 323 456	11.67
AÇÕES EUA						2 370 988	2.24
AÇÕES EUA - INV. DIRETO						30 463	0.03
ESM3 S&P500 06/23	91004070056	3.00	4 181.25		USD	0	0.00
STELLANTIS NV	NL00150001Q9	2 148.00	14.18		EUR	30 463	0.03
AÇÕES EUA - INV. INDIRETO						2 340 525	2.22
TRowe US BlueCp €I	LU1136108674	39 636.67	29.09		EUR	1 153 031	1.09
MorganS US Advt Z\$	LU0360484686	4 898.74	100.85		USD	463 755	0.44
iShares SP500 Value	US4642874089	5 113.00	150.79		USD	723 739	0.69
AÇÕES ÁSIA						1 741 334	1.65
AÇÕES ÁSIA - INV. INDIRETO						1 741 334	1.65
TRowe Japan Eq I€A	LU2444288430	120 501.55	9.46		EUR	1 139 945	1.08
Xtrack MSCIJap €Hd4C	LU0659580079	21 469.00	28.01		EUR	601 390	0.57
AÇÕES EUROPEIAS						7 133 161	6.75
AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO						1 978 179	1.87
EDP Renováveis	ES0127797019	942.00	18.58		EUR	17 502	0.02
VGM3 EUR EUX 06/23	DE000C6EV128	14.00	4 232.00		EUR	0	0.00
BMW	DE0005190003	177.00	101.92		EUR	18 040	0.02
COMMERZBANK	DE000CBK1001	1 302.00	9.40		EUR	12 239	0.01
SIEMENS	DE0007236101	498.00	153.34		EUR	76 363	0.07
ALLIANZ	DE0008404005	139.00	199.98		EUR	27 797	0.03
BASF	DE000BASF111	645.00	44.42		EUR	28 648	0.03
BAYER AG	DE000BAY0017	583.00	52.14		EUR	30 398	0.03
RWE-RHEINISCH WEST..	DE0007037129	356.00	39.12		EUR	13 927	0.01
ADIDAS- SALOMON AG	DE000A1EWWW0	152.00	151.50		EUR	23 028	0.02
MERCK KGAA	DE0006599905	76.00	162.75		EUR	12 369	0.01
SAP SE	DE0007164600	414.00	122.18		EUR	50 583	0.05
DEUTSCHE TELEKOM	DE0005557508	2 416.00	20.75		EUR	50 120	0.05
Mercedes-Benz Grp AG	DE0007100000	494.00	69.77		EUR	34 466	0.03
INFINEON TECHNOLOGIE	DE0006231004	665.00	34.73		EUR	23 095	0.02
DEUTSCHE POST	DE0005552004	645.00	42.05		EUR	27 122	0.03
DEUTSCHE BOERSE AG	DE0005810055	85.00	161.50		EUR	13 728	0.01
VONOVIA SE	DE000A1ML7J1	797.00	17.16		EUR	13 677	0.01
DANONE	FR0000120644	232.00	55.34		EUR	12 839	0.01
AXA-UAP	FR0000120628	1 390.00	26.42		EUR	36 717	0.03
CARREFOUR	FR0000120172	684.00	17.19		EUR	11 755	0.01
PERNOD RICARD	FR0000120693	152.00	202.10		EUR	30 719	0.03
TotalEnergies SE	FR0000120271	1 146.00	53.08		EUR	60 830	0.06

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-05-31

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	132.00	399.00		EUR	52 668	0.05
Kering	FR0000121485	22.00	498.35		EUR	10 964	0.01
BNP	FR0000131104	341.00	54.01		EUR	18 417	0.02
AIR LIQUIDE	FR0000120073	315.00	156.64		EUR	49 342	0.05
SCHNEIDER	FR0000121972	219.00	161.34		EUR	35 333	0.03
L.V.M.H.	FR0000121014	156.00	813.90		EUR	126 968	0.12
MICHELIN	FR001400AJ45	616.00	26.56		EUR	16 361	0.02
SAINT-GOBAIN	FR0000125007	525.00	51.80		EUR	27 195	0.03
THOMSON	FR0000121329	114.00	130.30		EUR	14 854	0.01
SOCIETE GENERALE	FR0000130809	1 228.00	21.63		EUR	26 562	0.03
CAP GEMINI SOGETI	FR0000125338	177.00	162.80		EUR	28 816	0.03
EssilorLuxottica	FR0000121667	142.00	168.44		EUR	23 918	0.02
GLE ENTREP. VINCI	FR0000125486	302.00	106.32		EUR	32 109	0.03
ST MICROELECTRON	NL0000226223	347.00	40.57		EUR	14 078	0.01
SANOFI SYNHLABO	FR0000120578	539.00	94.88		EUR	51 140	0.05
VEOLIA ENVIRONEMENT	FR0000124141	472.00	27.54		EUR	12 999	0.01
AIRBUS SE	NL0000235190	406.00	122.54		EUR	49 751	0.05
SAFRAN SA	FR0000073272	89.00	135.44		EUR	12 054	0.01
HERMES INTERNACIONAL	FR0000052292	23.00	1 901.80		EUR	43 741	0.04
TELEPERFORMANCE	FR0000051807	56.00	139.90		EUR	7 834	0.01
RECKITT BENCKISER	GB00B24CGK77	183.00	62.46		GBP	13 299	0.01
OCADO GROUP PLC	GB00B3MBS747	1 628.00	3.69		GBP	6 989	0.01
GLENCORE PLC	JE00B4T3BW64	1 768.00	4.11		GBP	8 464	0.01
ASHTREAD GROUP PLC	GB0000536739	165.00	49.00		GBP	9 407	0.01
AMADEUS HOLDING SA	ES0109067019	412.00	66.90		EUR	27 563	0.03
SHELL PLC-NEW	GB00BP6MXD84	341.00	26.19		EUR	8 931	0.01
TELEFONICA	ES0178430E18	4 301.00	3.97		EUR	17 075	0.02
BCO SANTANDER C.HISP	ES0113900J37	10 692.00	3.05		EUR	32 557	0.03
FERROVIAL	ES0118900010	373.00	28.95		EUR	10 798	0.01
INDITEX	ES0148396007	809.00	31.29		EUR	25 314	0.02
BANCO SABADELL SA	ES0113860A34	14 574.00	0.92		EUR	13 466	0.01
CAIXABANK SA	ES0140609019	6 462.00	3.43		EUR	22 145	0.02
CELLNEX TELECOM SAU	ES0105066007	364.00	37.91		EUR	13 799	0.01
UNICREDITO ITALIANO	IT0005239360	2 194.00	17.91		EUR	39 303	0.04
ENI SPA	IT0003132476	1 719.00	12.45		EUR	21 402	0.02
ENEL	IT0003128367	6 377.00	5.86		EUR	37 356	0.04
FINECOBANK SPA	IT0000072170	1 950.00	12.41		EUR	24 200	0.02
TELE2 AB - B SHS	SE0005190238	755.00	98.60		SEK	6 414	0.01
ESSITY AKTIEBO-B	SE0009922164	369.00	288.40		SEK	9 169	0.01
C.FIN.RICHMONT	CH0210483332	86.00	144.55		CHF	12 781	0.01

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-05-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
DSM-Firmenich AG	CH1216478797	109.00	104.04		EUR	11 340	0.01
KONINKLIJKE AHOLD NV	NL0011794037	483.00	29.66		EUR	14 326	0.01
ING GROEP NV	NL0011821202	3 152.00	11.51		EUR	36 273	0.03
KONINKLIJKE PHILIPS	NL0000009538	683.00	17.65		EUR	12 052	0.01
ASML NA	NL0010273215	248.00	671.50		EUR	166 532	0.16
ASR NEDERLAND NV	NL0011872643	289.00	39.80		EUR	11 502	0.01
Prosus NV	NL0013654783	293.00	61.57		EUR	18 040	0.02
NOKIA A	FI0009000681		3.80		EUR	0	0.00
SAMPO OYJ-A SHS	FI0009003305	258.00	43.02		EUR	11 099	0.01
Neste Oyj	FI0009013296	310.00	35.37		EUR	10 965	0.01
ERST BK DER OEST.SPA	AT0000652011	570.00	30.27		EUR	17 254	0.02
CRH ORD	IE0001827041	619.00	44.10		EUR	27 298	0.03
AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO						5 154 982	4.88
ALZ EuroInd EqGwt WT	LU0852482198	557.27	2 245.11		EUR	1 251 126	1.18
Schrd Euro Eq IZ€	LU2004793787	24 979.18	54.42		EUR	1 359 409	1.29
Mirova EuroSustEq SI	LU1799977381	4 120.01	139.42		EUR	574 412	0.54
AB EuroZone Eq S1€	LU0528104002	11 873.44	34.72		EUR	412 246	0.39
iShares SMI Eq CHF	CH0008899764	3 236.00	116.76		CHF	388 460	0.37
iShares FTSE100 EqD	IE0005042456	90 270.00	7.34		GBP	771 111	0.73
UBS EMU Value €AD	LU0446734369	10 169.00	39.16		EUR	398 218	0.38
AÇÕES EMERGENTES						1 077 972	1.02
AÇÕES EMERGENTES - INV. INDIRETO						1 077 972	1.02
GS EmgMkt Eq I€Ac	LU1357028627	32 873.90	16.13		EUR	530 256	0.50
Wellington EM Eq €SA	LU2058844833	67 080.17	8.17		EUR	547 716	0.52
OBRIGAÇÕES						71 920 925	68.10
OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO						47 189 713	44.68
OBRIGAÇÕES GOVERNOS						15 405 913	14.59
OT 2.875% 07/2026	PTOTETOE0012	252 000.00	100.70%	6 253	EUR	260 014	0.25
DBR 0.25% 02/27	DE0001102416	1 985 000.00	92.67%	1 441	EUR	1 840 961	1.74
OBL 0% 10/2024	DE0001141802	1 241 000.00	96.13%		EUR	1 192 986	1.13
FRTR 0% 03/2025	FR0013415627	1 802 000.00	95.02%		EUR	1 712 188	1.62
FRTR 0% 02/2027	FR0014003513	1 987 000.00	90.73%		EUR	1 802 805	1.71
SPGB 0% 05/2024	ES0000012H33	797 000.00	96.86%		EUR	771 998	0.73
SPGB 0% 01/2027	ES0000012J15	1 578 000.00	89.81%		EUR	1 417 202	1.34
BTPS 0% 08/2026	IT0005454241	2 750 000.00	89.93%		EUR	2 473 103	2.34
BTPS 0% 12/2024	IT0005474330	1 302 000.00	95.05%		EUR	1 237 525	1.17
NETHER 0% 01/2026	NL0015000QL2	731 000.00	93.30%		EUR	682 016	0.65
RFGB 0% 09/2026	FI4000511449	205 000.00	91.62%		EUR	187 817	0.18
BGB 1% 06/2026	BE0000337460	1 032 000.00	95.12%	9 726	EUR	991 344	0.94
RAGB 0.75% 10/26	AT0000A1K9C8	728 000.00	93.81%	3 351	EUR	686 302	0.65

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-05-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES GOVERNOS

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
IRISH 1% 05/2026	IE00BV8C9418	157 000.00	95.27%	73	EUR	149 653	0.14
OBRIGAÇÕES CRÉDITO						31 783 801	30.09
GALPPL 2% 01/2026	PTGALCOM0013	500 000.00	94.42%	3 753	EUR	475 853	0.45
BCPPL 1.125% 02/2027	PTBCPHOM0066	600 000.00	86.41%	2 016	EUR	520 476	0.49
FIDELI 4.25% 09/2031	PTFIDBOM0009	500 000.00	86.64%	15 719	EUR	448 919	0.43
CXGD 0.375% 09/2027	PTCGDCOM0037	700 000.00	87.08%	1 820	EUR	611 352	0.58
CRLPL 2.5% 11/2026	PTCCCAOM0000	500 000.00	87.46%	7 123	EUR	444 428	0.42
MRKGR 1.625% 06/2079	XS2011260531	500 000.00	94.82%	3 673	EUR	477 788	0.45
DB 1% 11/2025	DE000DL19VR6	500 000.00	94.32%	2 658	EUR	474 268	0.45
NRPBBGR 0.1% 02/2026	DE000A3H2ZX9	700 000.00	86.82%	228	EUR	607 989	0.58
VW 0.125% 02/2027	XS2374595044	500 000.00	87.07%	187	EUR	435 557	0.41
DBOERS 0% 02/2026	DE000A3H2457	200 000.00	91.72%		EUR	183 438	0.17
LEGGR 0.875% 11/2027	DE000A254P51	500 000.00	85.43%	2 217	EUR	429 352	0.41
BAYNGR 4,25% 08/2029	XS2630112014	300 000.00	102.07%	210	EUR	306 426	0.29
ULFP 1% 02/2027	FR0013405032	600 000.00	88.06%	1 545	EUR	529 917	0.50
BPCEGP 0.625% 09/24	FR0013429073	500 000.00	95.58%	2 123	EUR	480 018	0.45
BNP 0.25% 04/2027	FR0014002X43	600 000.00	88.87%	201	EUR	533 403	0.51
BFCM 4,125% 03/2029	FR001400GGZ0	500 000.00	101.23%	4 508	EUR	510 643	0.48
ACAFP 3,875% 04/2031	FR001400HCR4	500 000.00	99.50%	2 223	EUR	499 703	0.47
LRFP 3.5% 05/2029	FR001400I5S6	300 000.00	101.00%	86	EUR	303 074	0.29
HSBC 1.5% 12/2024	XS1917601582	500 000.00	98.73%	3 678	EUR	497 328	0.47
LLOYDS 0.375% 01/25	XS2109394077	500 000.00	94.34%	637	EUR	472 322	0.45
BPLN 3.25% PERP	XS2193661324	500 000.00	92.24%	15 315	EUR	476 490	0.45
VMUKLN 2.875% 06/25	XS2126084750	500 000.00	96.88%	6 279	EUR	490 659	0.46
NWG 1.375% 03/2027	XS2449911143	500 000.00	90.65%	1 709	EUR	454 979	0.43
CEPSA 1% 02/2025	XS1996435688	500 000.00	94.87%	1 438	EUR	475 808	0.45
BKIASM 1.125% 11/26	ES0213307061	600 000.00	90.01%	3 717	EUR	543 771	0.51
SANSCF 0.375% 01/25	XS2100690036	500 000.00	94.41%	693	EUR	472 723	0.45
BKTSM 0.625% 10/2027	ES0213679JR9	600 000.00	85.54%	2 445	EUR	515 655	0.49
CLNXSM 0.75% 11/2026	XS2300292617	500 000.00	88.80%	2 034	EUR	446 014	0.42
UCAJLN 4.5% 06/2025	ES0380907057	500 000.00	99.27%	20 712	EUR	517 052	0.49
SABSM 5.125% 11/2028	XS2553801502	500 000.00	100.77%	14 252	EUR	518 107	0.49
KUTXAB 4% 02/2028	ES0343307023	400 000.00	99.15%	5 260	EUR	401 840	0.38
SWEDA 0.25% 10/2024	XS2063261155	500 000.00	95.11%	805	EUR	476 340	0.45
SEB 4% 11/2026	XS2553798443	500 000.00	99.52%	11 178	EUR	508 753	0.48
SWEDA 4,25% 07/2028	XS2572496623	500 000.00	100.02%	8 209	EUR	508 299	0.48
ISPIM 1% 07/2024	XS2022425297	500 000.00	96.78%	4 548	EUR	488 433	0.46
UCGIM 5.85% 11/2027	XS2555420103	500 000.00	102.29%	15 867	EUR	527 312	0.50
EMR 0.375% 05/2024	XS1999902502	500 000.00	96.67%	51	EUR	483 421	0.46
JEF 1% 07/2024	XS2030530450	500 000.00	95.50%	4 342	EUR	481 832	0.46

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-05-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
BAC 1.379% 02/2025	XS1560863802	600 000.00	98.14%	2 584	EUR	591 394	0.56
MS 0.406% 10/2027	XS2338643740	600 000.00	87.71%	1 435	EUR	527 695	0.50
DLR 2.5% 01/2026	XS1891174341	500 000.00	93.66%	4 658	EUR	472 953	0.45
C 2.125% 09/2026	XS1107727007	500 000.00	94.25%	7 685	EUR	478 925	0.45
JPM 0.389% 02/2028	XS2123320033	500 000.00	87.54%	517	EUR	438 207	0.41
MS 4.813% 10/2028	XS2548080832	500 000.00	102.05%	14 439	EUR	524 684	0.50
VFC 4,25% 03/2029	XS2592659671	500 000.00	99.70%	4 993	EUR	503 483	0.48
MCD 4% 03/2030	XS2595418166	400 000.00	101.65%	3 760	EUR	410 360	0.39
NIBCAP 0.875% 07/25	XS2023631489	500 000.00	91.43%	3 932	EUR	461 077	0.44
REPSM 0.25% 08/2027	XS2035620710	200 000.00	87.97%	415	EUR	176 351	0.17
ANNGR 1.5% 06/2026	DE000A182VT2	500 000.00	90.74%	7 315	EUR	460 990	0.44
INTNED 1.25% 02/27	XS2443920249	500 000.00	92.02%	1 798	EUR	461 878	0.44
VW 4.25% 02/2028	XS2554488978	500 000.00	100.42%	6 171	EUR	508 266	0.48
INTNED 4.875% 11/27	XS2554746185	500 000.00	101.60%	13 289	EUR	521 284	0.49
TOYOTA 3,5% 01/2028	XS2572989817	400 000.00	99.51%	5 332	EUR	403 356	0.38
SIENFI 4,25% 04/2029	XS2601459162	300 000.00	100.35%	1 986	EUR	303 033	0.29
RABOBK 4,233% 04/29	XS2613658041	500 000.00	100.09%	2 140	EUR	502 565	0.48
NYKRE 0.75% 01/2027	DK0009526998	500 000.00	87.61%	1 356	EUR	439 391	0.42
CARLB 0.375% 06/2027	XS2191509038	400 000.00	87.90%	1 381	EUR	352 969	0.33
SYDBDC 4.75% 09/2025	XS2538445581	500 000.00	99.57%	15 877	EUR	513 702	0.49
SPOLNO 0.25% 09/2024	XS2057872595	500 000.00	94.86%	836	EUR	475 146	0.45
NESVFH 0.75% 03/2028	FI4000496286	500 000.00	87.23%	697	EUR	436 837	0.41
OPBANK 2.875% 12/25	XS2530506752	300 000.00	97.63%	3 970	EUR	296 857	0.28
RBIAB 0.25% 01/2025	XS2106056653	600 000.00	92.95%	534	EUR	558 204	0.53
DLTAS 2008-1 A	XS0390756285	12 196.94	99.68%	13	EUR	12 170	0.01
TRAGR 4.125% 11/2025	DE000A3LBGG1	500 000.00	99.83%	10 793	EUR	509 963	0.48
SUMIBK 1.413 06/27	XS1621087516	600 000.00	90.24%	8 176	EUR	549 604	0.52
TACHEM 2.25% 11/2026	XS1843449122	500 000.00	95.79%	5 918	EUR	484 873	0.46
MUFG 0.339% 07/2024	XS2028899727	300 000.00	96.00%	883	EUR	288 874	0.27
ANZ 1.125% 11/21/29	XS2082818951	500 000.00	94.02%	2 959	EUR	473 079	0.45
ALVGR Var 4.75%10/23	DE000A1YCQ29	600 000.00	99.79%	17 178	EUR	615 888	0.58
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO						24 731 211	23.42
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO - GOVERNOS						24 731 211	23.42
JPM Eur Gvt Bd I	LU0355584201	7 678.13	110.51		EUR	848 495	0.80
BlueBay Eur GvtBd Q	LU1170327958	12 869.01	98.93		EUR	1 273 131	1.21
iShares Eur GvtBd I	IE00B4WXJ64	134 166.00	108.71		EUR	14 585 186	13.81
Xtrack US TSY €Hd	LU1399300455	83 058.00	96.61		EUR	8 024 400	7.60
ALTERNATIVOS						921 337	0.87
CAIXA PRIVATE EQUITY	PTYME4LE0005	40 509.00	6.23		EUR	252 432	0.24
CAIXA INFRAESTRUTURA	PTYME7LE0002	82 413.00	8.12		EUR	668 905	0.63

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-05-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

IMOBILIÁRIO > IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
IMOBILIÁRIO						17 106 168	16.20
IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO						4 966 000	4.70
REPUBLICA 35- R/C	P50040000002	8.00			EUR	4 966 000	4.70
IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO						12 140 168	11.49
CXG IMOBILIARIO	PTYMESHE0009	710 909.00	4.21		EUR	2 994 064	2.83
Fundimo	PTYCXTHM0007	1 088 472.00	8.40		EUR	9 146 104	8.66
LIQUIDEZ						3 345 288	3.17
TOTAL						105 617 173	100.00

Saldos de Unidades de Participação

	Peso (%)	Valor (EUR)
Valor (EUR)	100.00	105 617 173.260000
Quantidade		7 993 762.839349
Cotação 2023-06-01 (EUR)		13.212400

Câmbios

CHF / EUR	1.028119
DKK / EUR	0.134275
EUR / EUR	1.000000
GBP / EUR	1.163481
NOK / EUR	0.084031
SEK / EUR	0.086161
USD / EUR	0.938703