

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2024-05-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
AÇÕES						10 448 787	10.64
AÇÕES EUA						2 087 516	2.13
AÇÕES EUA - INV. DIRETO						0	0.00
ESM4 S&P500 06/24	91004070060	2.00	5 210.75		USD	0	0.00
AÇÕES EUA - INV. INDIRETO						2 087 516	2.13
TRowe US BlueCp €I	LU1136108674	17 879.46	39.21		EUR	701 054	0.71
MorganS US Advt Z\$	LU0360484686	3 122.48	114.75		USD	330 357	0.34
JPMorgan-Us S Eq EUR	LU0973529505	2 097.13	246.67		EUR	517 298	0.53
iShares SP500 Value	US4642874089	3 215.00	181.77		USD	538 807	0.55
AÇÕES ÁSIA						1 003 064	1.02
AÇÕES ÁSIA - INV. INDIRETO						1 003 064	1.02
Amun Msci Jp-Acc €	92318000042	61 908.00	16.20		EUR	1 003 064	1.02
AÇÕES EUROPEIAS						6 278 543	6.39
AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO						1 524 012	1.55
EDP Renováveis	ES0127797019	612.00	14.72		EUR	9 009	0.01
VGM4 EUR EUX 06/24	DE000C6XKBW6	10.00	4 980.00		EUR	0	0.00
BMW	DE0005190003	114.00	93.18		EUR	10 623	0.01
COMMERZBANK	DE000CBK1001	832.00	15.54		EUR	12 929	0.01
SIEMENS	DE0007236101	318.00	176.26		EUR	56 051	0.06
BAYER AG	DE000BAY0017	373.00	28.24		EUR	10 534	0.01
RWE-RHEINISCH WEST..	DE0007037129	329.00	34.84		EUR	11 462	0.01
MUNCHENER RUCKVERS.	DE0008430026	61.00	457.90		EUR	27 932	0.03
ADIDAS- SALOMON AG	DE000A1EWWW0	98.00	231.50		EUR	22 687	0.02
MERCK KGAA	DE0006599905	73.00	166.50		EUR	12 155	0.01
SAP SE	DE0007164600	265.00	165.96		EUR	43 979	0.04
DEUTSCHE TELEKOM	DE0005557508	1 389.00	22.29		EUR	30 961	0.03
HEIDELBERGER ZEMENT	DE0006047004	67.00	95.72		EUR	6 413	0.01
Mercedes-Benz Grp AG	DE0007100000	316.00	66.40		EUR	20 982	0.02
INFINEON TECHNOLOGIE	DE0006231004	183.00	36.83		EUR	6 739	0.01
DEUTSCHE POST	DE0005552004	230.00	38.66		EUR	8 892	0.01
VONOVIA SE	DE000A1ML7J1	509.00	28.80		EUR	14 659	0.01
DANONE	FR0000120644	148.00	59.12		EUR	8 750	0.01
AXA-UAP	FR0000120628	888.00	33.05		EUR	29 348	0.03
PERNOD RICARD	FR0000120693	101.00	136.95		EUR	13 832	0.01
TotalEnergies SE	FR0000120271	732.00	67.01		EUR	49 051	0.05
L OREAL	FR0000120321	77.00	452.10		EUR	34 812	0.04
BNP	FR0000131104	474.00	67.70		EUR	32 090	0.03
AIR LIQUIDE	FR0000120073	208.00	180.46		EUR	37 536	0.04

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2024-05-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
SCHNEIDER	FR0000121972	228.00	227.45		EUR	51 859	0.05
L.V.M.H.	FR0000121014	105.00	734.90		EUR	77 165	0.08
MICHELIN	FR001400AJ45	213.00	37.15		EUR	7 913	0.01
SAINT-GOBAIN	FR0000125007	213.00	80.58		EUR	17 164	0.02
THOMSON	FR0000121329	74.00	166.65		EUR	12 332	0.01
SOCIETE GENERALE	FR0000130809	581.00	27.39		EUR	15 914	0.02
CAP GEMINI SOGETI	FR0000125338	114.00	185.60		EUR	21 158	0.02
EssilorLuxottica	FR0000121667	90.00	205.30		EUR	18 477	0.02
GLE ENTREP. VINCI	FR0000125486	220.00	114.45		EUR	25 179	0.03
SANOFI SYNHLABO	FR0000120578	387.00	89.76		EUR	34 737	0.04
VEOLIA ENVIRONEMENT	FR0000124141	453.00	30.70		EUR	13 907	0.01
AIRBUS SE	NL0000235190	260.00	155.90		EUR	40 534	0.04
SAFRAN SA	FR0000073272	57.00	214.10		EUR	12 204	0.01
HERMES INTERNACIONAL	FR0000052292	14.00	2 176.00		EUR	30 464	0.03
AMUNDI SA	FR0004125920	171.00	70.65		EUR	12 081	0.01
CRH PLC	IE0001827041	208.00	61.18		GBP	14 941	0.02
RECKITT BENCKISER	GB00B24CGK77	117.00	44.52		GBP	6 116	0.01
OCADO GROUP PLC	GB00B3MBS747	742.00	3.74		GBP	3 255	0.00
ASHTREAD GROUP PLC	GB0000536739	106.00	56.88		GBP	7 079	0.01
AMADEUS HOLDING SA	ES0109067019	263.00	65.34		EUR	17 184	0.02
SHELL PLC-NEW	GB00BP6MXD84	218.00	33.21		EUR	7 239	0.01
BCO SANTANDER C.HISP	ES0113900J37	6 833.00	4.83		EUR	33 034	0.03
FERROVIAL SE	NL0015001FS8	281.00	36.26		EUR	10 189	0.01
INDITEX	ES0148396007	517.00	43.56		EUR	22 521	0.02
BANCO SABADELL SA	ES0113860A34	5 833.00	1.94		EUR	11 307	0.01
CAIXABANK SA	ES0140609019	4 130.00	5.27		EUR	21 765	0.02
CELLNEX TELECOM SAU	ES0105066007	370.00	33.53		EUR	12 406	0.01
Puig Brands SA	ES0105777017	490.00	26.00		EUR	12 740	0.01
UNICREDITO ITALIANO	IT0005239360	948.00	36.39		EUR	34 493	0.04
ENI SPA	IT0003132476	1 099.00	14.50		EUR	15 931	0.02
ENEL	IT0003128367	6 055.00	6.66		EUR	40 302	0.04
FINECOBANK SPA	IT0000072170	1 246.00	14.85		EUR	18 497	0.02
ESSITY AKTIEBO-B	SE0009922164	304.00	269.50		SEK	7 163	0.01
C.FIN.RICHMONT	CH0210483332	55.00	144.05		CHF	8 085	0.01
DSM-Firmenich AG	CH1216478797	126.00	105.65		EUR	13 312	0.01
KONINKLIJKE AHOLD NV	NL0011794037	324.00	28.54		EUR	9 247	0.01
ING GROEP NV	NL0011821202	1 807.00	16.36		EUR	29 570	0.03
ASML NA	NL0010273215	159.00	870.80		EUR	138 457	0.14
STELLANTIS NV	NL00150001Q9	1 063.00	20.20		EUR	21 473	0.02
FERRARI NV	NL0011585146	51.00	377.40		EUR	19 247	0.02

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2024-05-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
ASR NEDERLAND NV	NL0011872643	356.00	44.40		EUR	15 806	0.02
Prosus NV	NL0013654783	407.00	33.38		EUR	13 586	0.01
Adyen NV	NL0012969182	10.00	1 184.80		EUR	11 848	0.01
Universal Music Grp	NL0015000IY2	504.00	28.58		EUR	14 404	0.01
STMICROELECTRONICS	92110000110	415.00	37.86		EUR	15 710	0.02
Neste Oyj	FI0009013296	198.00	19.27		EUR	3 814	0.00
ERST BK DER OEST.SPA	AT0000652011	239.00	45.10		EUR	10 779	0.01
AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO						4 754 531	4.84
Schrd Euro Eq IZ€	LU2004793787	12 956.83	58.86		EUR	762 621	0.78
Amundi Eurl Eq-J2Ec	LU1883305259	625.41	2 389.57		EUR	1 494 471	1.52
Goldman Sachs-Q Eur	LU2639511745	127.27	5 796.76		EUR	737 736	0.75
iShares SMI Eq CHF	CH0008899764	2 630.00	125.42		CHF	336 617	0.34
iShares FTSE100 EqD	IE0005042456	87 270.00	8.14		GBP	833 856	0.85
Ishares € Mkt Grw	IE00B0M62V02	6 520.00	60.67		EUR	395 568	0.40
Lyxor Msciemu Grwt	LU1598688189	996.00	194.44		EUR	193 662	0.20
AÇÕES EMERGENTES						1 079 664	1.10
AÇÕES EMERGENTES - INV. INDIRETO						1 079 664	1.10
GS EmgMkt Eq I€Ac	LU1357028627	28 773.90	17.69		EUR	509 010	0.52
Wellington EM Eq €SA	LU2058844833	64 880.17	8.80		EUR	570 654	0.58
OBRIGAÇÕES						66 345 233	67.55
OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO						44 120 501	44.92
OBRIGAÇÕES GOVERNOS						13 479 038	13.72
OT 2.875% 07/2026	PTOTETO0012	354 000.00	99.54%	8 787	EUR	361 148	0.37
DBR 0.25% 02/27	DE0001102416	2 422 000.00	93.26%	1 770	EUR	2 260 624	2.30
DBR 0.25% 08/2028	DE0001102457	486 000.00	90.41%	966	EUR	440 378	0.45
FRTR 0% 02/2027	FR0014003513	2 893 000.00	92.03%		EUR	2 662 312	2.71
FRTR 2,75% 02/2029	FR001400HI98	413 000.00	98.85%	3 010	EUR	411 248	0.42
SPGB 1.4% 07/28	ES0000012B88	1 014 000.00	93.50%	11 908	EUR	959 967	0.98
SPGB 0% 01/2026	ES0000012G91	1 065 000.00	94.79%		EUR	1 009 514	1.03
BTPS 0% 08/2026	IT0005454241	2 154 000.00	92.89%		EUR	2 000 808	2.04
BTPS 0,5% 07/2028	IT0005445306	1 037 000.00	88.87%	1 966	EUR	923 579	0.94
NETHER 0.75% 07/27	NL0012171458	581 000.00	93.58%	3 834	EUR	547 504	0.56
RFGB 0% 09/2026	FI4000511449	259 000.00	93.15%		EUR	241 248	0.25
BGB 0.8% 06/27	BE0000341504	925 000.00	93.57%	6 975	EUR	872 498	0.89
RAGB 0.75% 10/26	AT0000A1K9C8	641 000.00	94.77%	2 955	EUR	610 405	0.62
IRISH 1% 05/2026	IE00BV8C9418	185 000.00	96.06%	86	EUR	177 805	0.18
OBRIGAÇÕES CRÉDITO						30 641 463	31.20
GALPL 2% 01/2026	PTGALCOM0013	500 000.00	96.70%	3 770	EUR	487 290	0.50
BCPPL 1.125% 02/2027	PTBCPHOM0066	300 000.00	94.97%	1 014	EUR	285 936	0.29
FIDELI 4.25% 09/2031	PTFIDBOM0009	500 000.00	96.62%	15 734	EUR	498 844	0.51

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2024-05-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
CXGD 0.375% 09/2027	PTCGDCOM0037	500 000.00	92.32%	1 301	EUR	462 921	0.47
CRLPL 2.5% 11/2026	PTCCCAOM0000	500 000.00	96.63%	7 138	EUR	490 263	0.50
FLOEPT 4,875% 07/28	PTGGDDOM0008	500 000.00	101.97%	22 244	EUR	532 084	0.54
NOVBNC 4,25% 03/2028	PTNOBIOM0006	500 000.00	99.78%	4 949	EUR	503 849	0.51
FIDELI 7 3/4 PERP	PTFIDAOM0000	600 000.00	100.10%	379	EUR	600 973	0.61
MRKGR 1.625% 06/2079	XS2011260531	500 000.00	98.42%	3 685	EUR	495 775	0.50
DB 1% 11/2025	DE000DL19VR6	300 000.00	98.61%	1 598	EUR	297 419	0.30
VW 0.125% 02/2027	XS2374595044	500 000.00	90.81%	188	EUR	454 248	0.46
LEGGR 0.875% 11/2027	DE000A254P51	500 000.00	90.58%	2 223	EUR	455 128	0.46
IFXGR 3,375% 02/2027	XS2767979052	400 000.00	99.32%	3 541	EUR	400 805	0.41
ULFP 1% 02/2027	FR0013405032	400 000.00	92.77%	1 038	EUR	372 110	0.38
BNP 0.25% 04/2027	FR0014002X43	400 000.00	93.54%	134	EUR	374 290	0.38
CAFP 4,125% 10/2028	FR001400D0F9	500 000.00	101.61%	13 130	EUR	521 155	0.53
BFCM 4,125% 03/2029	FR001400GGZ0	300 000.00	101.89%	2 712	EUR	308 370	0.31
ACAFP 3,875% 04/2031	FR001400HCR4	200 000.00	101.01%	892	EUR	202 910	0.21
ENGIFP 3,875% 01/31	FR001400KHG0	500 000.00	100.35%	7 782	EUR	509 527	0.52
AKEFP 4,25% 05/2030	FR001400M2R9	500 000.00	101.81%	699	EUR	509 754	0.52
RENAUL 4,875% 10/29	FR001400KY69	500 000.00	103.15%	16 183	EUR	531 943	0.54
BPLN 3.25% PERP	XS2193661324	500 000.00	97.25%	15 318	EUR	501 543	0.51
NWG 1.375% 03/2027	XS2449911143	500 000.00	93.78%	1 714	EUR	470 604	0.48
CEPSA 1% 02/2025	XS1996435688	100 000.00	97.93%	290	EUR	98 221	0.10
BKIASM 1.125% 11/26	ES0213307061	400 000.00	93.42%	2 484	EUR	376 172	0.38
BKTSM 0.625% 10/2027	ES0213679JR9	300 000.00	90.07%	1 224	EUR	271 431	0.28
CLNXSM 0.75% 11/2026	XS2300292617	500 000.00	92.78%	2 039	EUR	465 939	0.47
UCAJLN 4.5% 06/2025	ES0380907057	200 000.00	100.02%	8 287	EUR	208 321	0.21
SABSM 5.125% 11/2028	XS2553801502	500 000.00	104.01%	14 283	EUR	534 343	0.54
KUTXAB 4% 02/2028	ES0343307023	400 000.00	100.47%	5 290	EUR	407 158	0.41
ABANCA 5,875% 04/30	ES0265936056	300 000.00	106.94%	2 897	EUR	323 717	0.33
EDPPL 4,125% 04/2029	XS2699159278	500 000.00	101.24%	3 277	EUR	509 482	0.52
ABESM 2,25% 03/2029	XS2195092601	500 000.00	92.95%	1 973	EUR	466 728	0.48
SWEDA 4,375% 09/2030	XS2676305779	500 000.00	102.57%	16 137	EUR	528 977	0.54
UCGIM 5.85% 11/2027	XS2555420103	300 000.00	104.35%	9 542	EUR	322 586	0.33
CMCSA 0.25% 05/2027	XS2114852218	300 000.00	90.73%	25	EUR	272 200	0.28
DOW 0.5% 03/2027	XS2122485845	400 000.00	91.34%	427	EUR	365 771	0.37
MS 0.406% 10/2027	XS2338643740	400 000.00	92.28%	958	EUR	370 090	0.38
DLR 2.5% 01/2026	XS1891174341	500 000.00	97.31%	4 679	EUR	491 219	0.50
JPM 0.389% 02/2028	XS2123320033	500 000.00	91.47%	521	EUR	457 891	0.47
MS 4.813% 10/2028	XS2548080832	500 000.00	103.13%	14 465	EUR	530 105	0.54
VFC 4,25% 03/2029	XS2592659671	500 000.00	94.91%	5 007	EUR	479 567	0.49
MCD 4% 03/2030	XS2595418166	400 000.00	101.53%	3 770	EUR	409 898	0.42

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2024-05-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
BAC 4,134% 06/2028	XS2634687912	300 000.00	101.72%	12 029	EUR	317 195	0.32
GE 1,5% 05/2029	XS1612543121	500 000.00	90.50%	308	EUR	452 813	0.46
T 2,6% 12/2029	XS1144088165	500 000.00	94.20%	5 932	EUR	476 937	0.49
FIS 1% 12/2028	XS2085655590	500 000.00	88.45%	2 473	EUR	444 713	0.45
BKNG 3,5% 03/2029	XS2776511060	300 000.00	99.20%	2 647	EUR	300 259	0.31
KHC 3,5% 03/2029	XS2776793965	500 000.00	99.03%	3 740	EUR	498 885	0.51
JEF 4% 04/2029	XS2801963716	500 000.00	98.51%	2 521	EUR	495 091	0.50
NIBCAP 0.875% 07/25	XS2023631489	500 000.00	96.60%	3 933	EUR	486 908	0.50
REPSM 0.25% 08/2027	XS2035620710	200 000.00	89.91%	415	EUR	180 227	0.18
ANNGR 1.5% 06/2026	DE000A182VT2	500 000.00	95.09%	7 316	EUR	482 751	0.49
INTNED 1.25% 02/27	XS2443920249	500 000.00	95.67%	1 810	EUR	480 145	0.49
VW 4.25% 02/2028	XS2554488978	500 000.00	101.18%	6 212	EUR	512 107	0.52
INTNED 4.875% 11/27	XS2554746185	500 000.00	102.25%	13 320	EUR	524 585	0.53
RABOBK 4,233% 04/29	XS2613658041	300 000.00	101.51%	1 287	EUR	305 802	0.31
SIEGR 1,375% 09/2030	XS1874127902	500 000.00	89.23%	5 053	EUR	451 213	0.46
SDZSW 4,22% 04/2030	XS2715940891	500 000.00	101.72%	2 601	EUR	511 221	0.52
MBGGR 3% 07/2027	DE000A3LSYG8	300 000.00	98.48%	3 516	EUR	298 944	0.30
ENELIM 3.375% 07/28	XS2751666426	300 000.00	98.62%	3 606	EUR	299 454	0.30
CARLB 0.375% 06/2027	XS2191509038	400 000.00	90.49%	1 381	EUR	363 337	0.37
NYKRE 4,625% 01/2029	DK0030512421	500 000.00	102.69%	8 467	EUR	521 917	0.53
DNBNO 4,625% 11/2029	XS2698148702	500 000.00	103.22%	13 458	EUR	529 563	0.54
NESVFH 0.75% 03/2028	FI4000496286	500 000.00	88.90%	699	EUR	445 199	0.45
NDAFH 0,625% 08/2031	XS2343459074	400 000.00	92.96%	1 967	EUR	373 823	0.38
RBIAB 0.25% 01/2025	XS2106056653	300 000.00	97.50%	268	EUR	292 756	0.30
ARNDTN 0.375 04/2027	XS2421195848	400 000.00	86.23%	193	EUR	345 129	0.35
TRAGR 4.125% 11/2025	DE000A3LBGG1	200 000.00	100.03%	4 328	EUR	204 390	0.21
BDX 3,553% 09/2029	XS2585932275	500 000.00	98.83%	12 717	EUR	506 862	0.52
TACHEM 2.25% 11/2026	XS1843449122	400 000.00	96.57%	4 746	EUR	391 030	0.40
ANZ 1.125% 11/21/29	XS2082818951	500 000.00	98.28%	2 966	EUR	494 386	0.50
BNS 3,5% 04/2029	XS2804565435	500 000.00	98.82%	2 158	EUR	496 263	0.51
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO						22 224 732	22.63
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO - GOVERNOS						22 224 732	22.63
JPM Eur Gvt Bd I	LU0355584201	7 427.13	113.84		EUR	845 527	0.86
BlueBay Eur GvtBd Q	LU1170327958	11 418.84	102.56		EUR	1 171 116	1.19
iShares Eur GvtBd I	IE00B4WXJJ64	122 706.00	109.12		EUR	13 389 679	13.63
Xtrack US TSY €Hd	LU1399300455	74 554.00	91.46		EUR	6 818 411	6.94
ALTERNATIVOS						918 229	0.93
CAIXA PRIVATE EQUITY	PTYME4LE0005	40 509.00	6.84		EUR	276 899	0.28
CAIXA INFRAESTRUTURA	PTYME7LE0002	82 413.00	7.78		EUR	641 330	0.65
IMOBILIÁRIO						17 711 813	18.03

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2024-05-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

IMOBILIÁRIO > IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO						5 563 000	5.66
REPUBLICA 35- R/C	P50040000002	8.00			EUR	5 563 000	5.66
IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO						12 148 813	12.37
CXG IMOBILIARIO	PTYMESHE0009	710 909.00	3.85		EUR	2 739 843	2.79
Fundimo	PTYCXTHM0007	1 088 472.00	8.64		EUR	9 408 970	9.58
LIQUIDEZ						2 795 242	2.85
TOTAL						98 219 303	100.00

Saldos de Unidades de Participação

	Peso (%)	Valor (EUR)
Valor (EUR)	100.00	98 219 303.390000
Quantidade		7 157 855.564509
Cotação 2024-06-01 (EUR)		13.721900

Câmbios

CHF / EUR	1.020502
DKK / EUR	0.134064
EUR / EUR	1.000000
GBP / EUR	1.174109
NOK / EUR	0.087640
SEK / EUR	0.087430
USD / EUR	0.921999