

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-06-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
AÇÕES						10 895 736	10.44
AÇÕES EUA						2 269 589	2.17
AÇÕES EUA - INV. DIRETO						29 268	0.03
ESU3 S&P500 09/23	91004070057	3.00	4 484.25		USD	0	0.00
STELLANTIS NV	NL00150001Q9	1 819.00	16.09		EUR	29 268	0.03
AÇÕES EUA - INV. INDIRETO						2 240 322	2.15
TRowe US BlueCp €I	LU1136108674	33 430.88	29.74		EUR	994 234	0.95
MorganS US Advt Z\$	LU0360484686	4 898.74	109.99		USD	493 418	0.47
iShares SP500 Value	US4642874089	5 113.00	160.75		USD	752 669	0.72
AÇÕES ÁSIA						1 002 015	0.96
AÇÕES ÁSIA - INV. INDIRETO						1 002 015	0.96
TRowe Japan Eq I€A	LU2444288430	106 370.99	9.42		EUR	1 002 015	0.96
AÇÕES EUROPEIAS						6 540 128	6.27
AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO						1 747 918	1.67
EDP Renováveis	ES0127797019	798.00	18.30		EUR	14 599	0.01
VGU3 EUR EUX 09/23	DE000C1TL5V9	13.00	4 430.00		EUR	0	0.00
BMW	DE0005190003	150.00	112.52		EUR	16 878	0.02
COMMERZBANK	DE000CBK1001	1 102.00	10.15		EUR	11 185	0.01
SIEMENS	DE0007236101	422.00	152.54		EUR	64 372	0.06
ALLIANZ	DE0008404005	118.00	213.20		EUR	25 158	0.02
BASF	DE000BASF111	546.00	44.47		EUR	24 281	0.02
BAYER AG	DE000BAY0017	494.00	50.67		EUR	25 031	0.02
RWE-RHEINISCH WEST..	DE0007037129	301.00	39.87		EUR	12 001	0.01
ADIDAS- SALOMON AG	DE000A1EWWW0	129.00	177.78		EUR	22 934	0.02
MERCK KGAA	DE0006599905	64.00	151.55		EUR	9 699	0.01
SAP SE	DE0007164600	351.00	125.14		EUR	43 924	0.04
DEUTSCHE TELEKOM	DE0005557508	2 046.00	19.98		EUR	40 871	0.04
Mercedes-Benz Grp AG	DE0007100000	418.00	73.67		EUR	30 794	0.03
INFINEON TECHNOLOGIE	DE0006231004	563.00	37.79		EUR	21 273	0.02
DEUTSCHE POST	DE0005552004	546.00	44.73		EUR	24 423	0.02
DEUTSCHE BOERSE AG	DE0005810055	72.00	169.10		EUR	12 175	0.01
VONOVIA SE	DE000A1ML7J1	675.00	17.90		EUR	12 079	0.01
DANONE	FR0000120644	196.00	56.14		EUR	11 003	0.01
AXA-UAP	FR0000120628	1 177.00	27.03		EUR	31 808	0.03
CARREFOUR	FR0000120172	579.00	17.36		EUR	10 049	0.01
PERNOD RICARD	FR0000120693	129.00	202.40		EUR	26 110	0.03
TotalEnergies SE	FR0000120271	970.00	52.55		EUR	50 974	0.05
L OREAL	FR0000120321	112.00	427.10		EUR	47 835	0.05

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-06-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
Kering	FR0000121485	19.00	505.60		EUR	9 606	0.01
BNP	FR0000131104	289.00	57.72		EUR	16 681	0.02
AIR LIQUIDE	FR0000120073	267.00	164.20		EUR	43 841	0.04
SCHNEIDER	FR0000121972	185.00	166.46		EUR	30 795	0.03
L.V.M.H.	FR0000121014	132.00	863.00		EUR	113 916	0.11
MICHELIN	FR001400AJ45	522.00	27.06		EUR	14 125	0.01
SAINT-GOBAIN	FR0000125007	445.00	55.73		EUR	24 800	0.02
THOMSON	FR0000121329	97.00	137.20		EUR	13 308	0.01
SOCIETE GENERALE	FR0000130809	1 040.00	23.80		EUR	24 752	0.02
CAP GEMINI SOGETI	FR0000125338	150.00	173.55		EUR	26 033	0.02
EssilorLuxottica	FR0000121667	120.00	172.60		EUR	20 712	0.02
GLE ENTREP. VINCI	FR0000125486	256.00	106.38		EUR	27 233	0.03
SANOFI SYNHLABO	FR0000120578	456.00	98.20		EUR	44 779	0.04
VEOLIA ENVIRONEMENT	FR0000124141	400.00	28.95		EUR	11 580	0.01
AIRBUS SE	NL0000235190	344.00	132.36		EUR	45 532	0.04
SAFRAN SA	FR0000073272	75.00	143.46		EUR	10 760	0.01
HERMES INTERNACIONAL	FR0000052292	19.00	1 990.00		EUR	37 810	0.04
TELEPERFORMANCE	FR0000051807	47.00	153.45		EUR	7 212	0.01
RECKITT BENCKISER	GB00B24CGK77	155.00	59.12		GBP	10 665	0.01
OCADO GROUP PLC	GB00B3MBS747	1 379.00	5.68		GBP	9 116	0.01
GLENCORE PLC	JE00B4T3BW64	1 497.00	4.45		GBP	7 745	0.01
ASHTREAD GROUP PLC	GB0000536739	140.00	54.44		GBP	8 870	0.01
AMADEUS HOLDING SA	ES0109067019	349.00	69.70		EUR	24 325	0.02
SHELL PLC-NEW	GB00BP6MXD84	289.00	27.60		EUR	7 975	0.01
TELEFONICA	ES0178430E18	3 642.00	3.72		EUR	13 534	0.01
BCO SANTANDER C.HISP	ES0113900J37	9 054.00	3.39		EUR	30 648	0.03
FERROVIAL SE	NL0015001FS8	373.00	28.97		EUR	10 806	0.01
INDITEX	ES0148396007	685.00	35.46		EUR	24 290	0.02
BANCO SABADELL SA	ES0113860A34	12 341.00	1.05		EUR	13 007	0.01
CAIXABANK SA	ES0140609019	5 472.00	3.79		EUR	20 722	0.02
CELLNEX TELECOM SAU	ES0105066007	308.00	36.99		EUR	11 393	0.01
UNICREDITO ITALIANO	IT0005239360	1 858.00	21.27		EUR	39 510	0.04
ENI SPA	IT0003132476	1 456.00	13.18		EUR	19 193	0.02
ENEL	IT0003128367	5 400.00	6.17		EUR	33 307	0.03
FINECOBANK SPA	IT0000072170	1 651.00	12.32		EUR	20 332	0.02
TELE2 AB - B SHS	SE0005190238	639.00	89.12		SEK	4 836	0.00
ESSITY AKTIEBO-B	SE0009922164	312.00	287.10		SEK	7 607	0.01
C.FIN.RICHMONT	CH0210483332	73.00	151.65		CHF	11 331	0.01
DSM-Firmenich AG	CH1216478797	92.00	98.62		EUR	9 073	0.01
KONINKLIJKE AHOLD NV	NL0011794037	409.00	31.26		EUR	12 785	0.01

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-06-30

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	2 669.00	12.34		EUR	32 930	0.03
KONINKLIJKE PHILIPS	NL0000009538	578.00	19.81		EUR	11 449	0.01
ASML NA	NL0010273215	210.00	663.00		EUR	139 230	0.13
ASR NEDERLAND NV	NL0011872643	245.00	41.24		EUR	10 104	0.01
Prosus NV	NL0013654783	248.00	67.11		EUR	16 643	0.02
STMicroelectronics	92110000110	294.00	45.57		EUR	13 396	0.01
SAMPO OYJ-A SHS	FI0009003305	218.00	41.12		EUR	8 964	0.01
Neste Oyj	FI0009013296	262.00	35.26		EUR	9 238	0.01
ERST BK DER OEST.SPA	AT0000652011	483.00	32.09		EUR	15 499	0.01
CRH ORD	IE0001827041	524.00	50.50		EUR	26 462	0.03
AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO						4 792 210	4.59
ALZ EuroInd EqGwt WT	LU0852482198	456.06	2 252.36		EUR	1 027 218	0.98
Schrd Euro Eq IZ€	LU2004793787	22 994.56	52.09		EUR	1 197 817	1.15
Mirova EuroSustEq SI	LU1799977381	4 120.01	139.51		EUR	574 783	0.55
AB EuroZone Eq S1€	LU0528104002	11 873.44	35.07		EUR	416 402	0.40
iShares SMI Eq CHF	CH0008899764	3 236.00	117.44		CHF	388 970	0.37
iShares FTSE100 EqD	IE0005042456	90 270.00	7.34		GBP	771 362	0.74
UBS EMU Value €AD	LU0446734369	10 169.00	40.88		EUR	415 658	0.40
AÇÕES EMERGENTES						1 084 003	1.04
AÇÕES EMERGENTES - INV. INDIRETO						1 084 003	1.04
GS EmgMkt Eq I€Ac	LU1357028627	32 873.90	16.25		EUR	534 201	0.51
Wellington EM Eq €SA	LU2058844833	67 080.17	8.20		EUR	549 802	0.53
OBRIGAÇÕES						71 495 525	68.49
OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO						46 852 774	44.88
OBRIGAÇÕES GOVERNOS						15 204 801	14.57
OT 2.875% 07/2026	PTOTETOE0012	253 000.00	99.69%	6 875	EUR	259 086	0.25
DBR 0.25% 02/27	DE0001102416	2 296 000.00	91.61%	2 139	EUR	2 105 458	2.02
OBL 0% 10/2024	DE0001141802	1 058 000.00	95.77%		EUR	1 013 289	0.97
FRTR 0% 03/2025	FR0013415627	1 237 000.00	94.48%		EUR	1 168 718	1.12
FRTR 0% 02/2027	FR0014003513	2 665 000.00	89.84%		EUR	2 394 236	2.29
SPGB 0% 01/2027	ES0000012J15	996 000.00	89.01%		EUR	886 530	0.85
SPGB 0% 01/2026	ES0000012G91	1 330 000.00	91.80%		EUR	1 220 940	1.17
BTPS 0% 08/2026	IT0005454241	3 068 000.00	89.22%		EUR	2 737 331	2.62
BTPS 0% 12/2024	IT0005474330	898 000.00	94.71%		EUR	850 505	0.81
NETHER 0% 01/2026	NL0015000QL2	747 000.00	92.63%		EUR	691 924	0.66
RFGB 0% 09/2026	FI4000511449	187 000.00	90.73%		EUR	169 671	0.16
BGB 1% 06/2026	BE0000337460	1 035 000.00	94.24%	255	EUR	975 670	0.93
RAGB 0.75% 10/26	AT0000A1K9C8	544 000.00	92.88%	2 839	EUR	508 079	0.49
IRISH 1% 05/2026	IE00BV8C9418	236 000.00	94.52%	303	EUR	223 366	0.21
OBRIGAÇÕES CRÉDITO						31 647 973	30.32

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-06-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
GALPPL 2% 01/2026	PTGALCOM0013	500 000.00	93.70%	4 575	EUR	473 090	0.45
BCPPL 1.125% 02/2027	PTBCPHOM0066	600 000.00	87.30%	2 571	EUR	526 383	0.50
FIDELI 4.25% 09/2031	PTFIDBOM0009	500 000.00	86.17%	17 466	EUR	448 331	0.43
CXGD 0.375% 09/2027	PTCGDCOM0037	700 000.00	86.78%	2 035	EUR	609 495	0.58
CRLPL 2.5% 11/2026	PTCCCAOM0000	500 000.00	87.82%	8 151	EUR	447 236	0.43
FLOEPT 4,875% 07/28	PTGGDDOM0008	500 000.00	99.91%		EUR	499 565	0.48
MRKGR 1.625% 06/2079	XS2011260531	500 000.00	94.76%	4 341	EUR	478 126	0.46
DB 1% 11/2025	DE000DL19VR6	500 000.00	94.33%	3 068	EUR	474 693	0.45
NRPBBGR 0.1% 02/2026	DE000A3H2ZX9	700 000.00	87.76%	286	EUR	614 599	0.59
VW 0.125% 02/2027	XS2374595044	500 000.00	86.32%	238	EUR	431 843	0.41
DBOERS 0% 02/2026	DE000A3H2457		90.93%		EUR	0	0.00
LEGGR 0.875% 11/2027	DE000A254P51	500 000.00	84.93%	2 577	EUR	427 212	0.41
BAYNGR 4,25% 08/2029	XS2630112014	300 000.00	100.80%	1 258	EUR	303 664	0.29
ULFP 1% 02/2027	FR0013405032	600 000.00	87.82%	2 038	EUR	528 928	0.51
BPCEGP 0.625% 09/24	FR0013429073	500 000.00	95.58%	2 380	EUR	480 255	0.46
BNP 0.25% 04/2027	FR0014002X43	600 000.00	88.35%	324	EUR	530 406	0.51
BFCM 4,125% 03/2029	FR001400GGZ0	500 000.00	99.74%	6 199	EUR	504 894	0.48
ACAFP 3,875% 04/2031	FR001400HCR4	500 000.00	98.67%	3 811	EUR	497 181	0.48
LRFP 3.5% 05/2029	FR001400I5S6		99.93%	947	EUR	947	0.00
HSBC 1.5% 12/2024	XS1917601582	500 000.00	98.86%	4 295	EUR	498 580	0.48
LLOYDS 0.375% 01/25	XS2109394077	500 000.00	93.99%	791	EUR	470 731	0.45
BPLN 3.25% PERP	XS2193661324	500 000.00	92.08%	400	EUR	460 790	0.44
VMUKLN 2.875% 06/25	XS2126084750	500 000.00	96.78%	275	EUR	484 185	0.46
NWG 1.375% 03/2027	XS2449911143	500 000.00	89.74%	2 273	EUR	450 993	0.43
CEPSA 1% 02/2025	XS1996435688	500 000.00	94.31%	1 849	EUR	473 399	0.45
BKIASM 1.125% 11/26	ES0213307061	600 000.00	89.50%	4 272	EUR	541 260	0.52
SANS CF 0.375% 01/25	XS2100690036	500 000.00	94.23%	848	EUR	472 013	0.45
BKTSM 0.625% 10/2027	ES0213679JR9	600 000.00	85.21%	2 753	EUR	514 013	0.49
CLNXSM 0.75% 11/2026	XS2300292617	500 000.00	88.13%	2 342	EUR	442 987	0.42
UCAJLN 4.5% 06/2025	ES0380907057	500 000.00	99.10%	61	EUR	495 536	0.47
SABSM 5.125% 11/2028	XS2553801502	500 000.00	100.66%	16 358	EUR	519 643	0.50
KUTXAB 4% 02/2028	ES0343307023	400 000.00	98.02%	6 575	EUR	398 643	0.38
SWEDA 0.25% 10/2024	XS2063261155	500 000.00	95.03%	908	EUR	476 043	0.46
SEB 4% 11/2026	XS2553798443	500 000.00	98.68%	12 822	EUR	506 222	0.48
SWEDA 4,25% 07/2028	XS2572496623	500 000.00	99.00%	9 955	EUR	504 940	0.48
ISPIM 1% 07/2024	XS2022425297	500 000.00	96.79%	4 959	EUR	488 929	0.47
UCGIM 5.85% 11/2027	XS2555420103	500 000.00	102.29%	18 271	EUR	529 711	0.51
EMR 0.375% 05/2024	XS1999902502	500 000.00	96.59%	205	EUR	483 155	0.46
JEF 1% 07/2024	XS2030530450	500 000.00	95.55%	4 753	EUR	482 483	0.46
BAC 1.379% 02/2025	XS1560863802	600 000.00	98.21%	3 264	EUR	592 530	0.57

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-06-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
MS 0.406% 10/2027	XS2338643740	600 000.00	87.17%	1 635	EUR	524 625	0.50
DLR 2.5% 01/2026	XS1891174341	500 000.00	93.00%	5 685	EUR	470 670	0.45
C 2.125% 09/2026	XS1107727007	500 000.00	93.81%	8 558	EUR	477 608	0.46
JPM 0.389% 02/2028	XS2123320033	500 000.00	86.69%	677	EUR	434 142	0.42
MS 4.813% 10/2028	XS2548080832	500 000.00	101.04%	16 417	EUR	521 627	0.50
VFC 4,25% 03/2029	XS2592659671	500 000.00	98.41%	6 735	EUR	498 780	0.48
MCD 4% 03/2030	XS2595418166	400 000.00	101.78%	5 071	EUR	412 191	0.39
BAC 4,134% 06/2028	XS2634687912	500 000.00	99.02%	1 073	EUR	496 183	0.48
NIBCAP 0.875% 07/25	XS2023631489	500 000.00	91.17%	4 291	EUR	460 151	0.44
REPSM 0.25% 08/2027	XS2035620710	200 000.00	87.03%	456	EUR	174 520	0.17
ANNGR 1.5% 06/2026	DE000A182VT2	500 000.00	90.43%	430	EUR	452 590	0.43
INTNED 1.25% 02/27	XS2443920249	500 000.00	91.48%	2 312	EUR	459 732	0.44
VW 4.25% 02/2028	XS2554488978	500 000.00	98.96%	7 918	EUR	502 703	0.48
INTNED 4.875% 11/27	XS2554746185	500 000.00	100.64%	15 293	EUR	518 498	0.50
TOYOTA 3,5% 01/2028	XS2572989817	400 000.00	98.62%	6 482	EUR	400 966	0.38
SIENFI 4,25% 04/2029	XS2601459162	300 000.00	97.09%	3 031	EUR	294 295	0.28
RABOBK 4,233% 04/29	XS2613658041	500 000.00	98.80%	3 874	EUR	497 879	0.48
NYKRE 0.75% 01/2027	DK0009526998	500 000.00	87.06%	1 664	EUR	436 964	0.42
CARLB 0.375% 06/2027	XS2191509038	400 000.00	87.15%	4	EUR	348 596	0.33
SYDBDC 4.75% 09/2025	XS2538445581	500 000.00	99.10%	17 829	EUR	513 344	0.49
SPOLNO 0.25% 09/2024	XS2057872595	500 000.00	94.74%	938	EUR	474 643	0.45
NESVFH 0.75% 03/2028	FI4000496286	500 000.00	86.42%	1 004	EUR	433 089	0.41
RBIAS 0.25% 01/2025	XS2106056653	600 000.00	92.82%	658	EUR	557 560	0.53
DLTAS 2008-1 A	XS0390756285	12 196.94	99.82%	12	EUR	12 186	0.01
TRAGR 4.125% 11/2025	DE000A3LBGG1	500 000.00	98.87%	12 488	EUR	506 813	0.49
SUMIBK 1.413 06/27	XS1621087516	600 000.00	89.77%	394	EUR	539 002	0.52
TACHEM 2.25% 11/2026	XS1843449122	500 000.00	94.60%	6 842	EUR	479 862	0.46
MUFG 0.339% 07/2024	XS2028899727	100 000.00	96.14%	322	EUR	96 459	0.09
ANZ 1.125% 11/21/29	XS2082818951	500 000.00	93.67%	3 421	EUR	471 766	0.45
ALVGR Var 4.75%10/23	DE000A1YCQ29	600 000.00	99.56%	19 521	EUR	616 893	0.59
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO						24 642 751	23.61
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO - GOVERNOS						24 642 751	23.61
JPM Eur Gvt Bd I	LU0355584201	7 678.13	111.12		EUR	853 194	0.82
BlueBay Eur GvtBd Q	LU1170327958	12 869.01	98.50		EUR	1 267 598	1.21
iShares Eur GvtBd I	IE00B4WXJJ64	134 166.00	108.52		EUR	14 559 023	13.95
Xtrack US TSY €Hd	LU1399300455	83 058.00	95.87		EUR	7 962 937	7.63
ALTERNATIVOS						914 164	0.88
CAIXA PRIVATE EQUITY	PTYPE4LE0005	40 509.00	6.22		EUR	252 148	0.24
CAIXA INFRAESTRUTURA	PTYPE7LE0002	82 413.00	8.03		EUR	662 015	0.63
IMOBILIÁRIO						17 032 383	16.32

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-06-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

IMOBILIÁRIO > IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO						4 966 000	4.76
REPUBLICA 35- R/C	P50040000002	8.00			EUR	4 966 000	4.76
IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO						12 066 383	11.56
CXG IMOBILIARIO	PTYMESHE0009	710 909.00	4.21		EUR	2 993 425	2.87
Fundimo	PTYCXTHM0007	1 088 472.00	8.34		EUR	9 072 958	8.69
LIQUIDEZ						4 051 558	3.88
TOTAL						104 389 366	100.00

Saldos de Unidades de Participação

	Peso (%)	Valor (EUR)
Valor (EUR)	100.00	104 389 365.640000
Quantidade		7 908 317.859229
Cotação 2023-07-01 (EUR)		13.199900

Câmbios

CHF / EUR	1.023510
DKK / EUR	0.134306
EUR / EUR	1.000000
GBP / EUR	1.163860
NOK / EUR	0.085512
SEK / EUR	0.084918
USD / EUR	0.915751