

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2024-06-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
AÇÕES						10 121 698	10.27
AÇÕES EUA						2 185 551	2.22
AÇÕES EUA - INV. DIRETO						0	0.00
ESU4 S&P500 09/24	91004070061	2.00	5 547.75		USD	0	0.00
AÇÕES EUA - INV. INDIRETO						2 185 551	2.22
TRowe US BlueCp €I	LU1136108674	17 879.46	42.21		EUR	754 692	0.77
MorganS US Advt Z\$	LU0360484686	3 122.48	117.84		USD	343 528	0.35
JPMorgan-Us S Eq EUR	LU0973529505	2 097.13	257.62		EUR	540 262	0.55
iShares SP500 Value	US4642874089	3 215.00	182.26		USD	547 069	0.56
AÇÕES ÁSIA						1 022 349	1.04
AÇÕES ÁSIA - INV. INDIRETO						1 022 349	1.04
Amun Msci Jp-Acc €	92318000042	61 908.00	16.51		EUR	1 022 349	1.04
AÇÕES EUROPEIAS						5 899 611	5.99
AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO						1 481 420	1.50
EDP Renováveis	ES0127797019	612.00	13.05		EUR	7 987	0.01
VGU4 EUR EUX 09/24	DE000C6XKBX4	10.00	4 932.00		EUR	0	0.00
BMW	DE0005190003	114.00	88.38		EUR	10 075	0.01
COMMERZBANK	DE000CBK1001	832.00	14.19		EUR	11 802	0.01
SIEMENS	DE0007236101	318.00	173.72		EUR	55 243	0.06
BAYER AG	DE000BAY0017	373.00	26.38		EUR	9 840	0.01
RWE-RHEINISCH WEST..	DE0007037129	329.00	31.95		EUR	10 512	0.01
MUNCHENER RUCKVERS.	DE0008430026	61.00	467.00		EUR	28 487	0.03
ADIDAS- SALOMON AG	DE000A1EWWW0	98.00	223.00		EUR	21 854	0.02
MERCK KGAA	DE0006599905	73.00	154.75		EUR	11 297	0.01
SAP SE	DE0007164600	265.00	189.52		EUR	50 223	0.05
DEUTSCHE TELEKOM	DE0005557508	1 389.00	23.48		EUR	32 614	0.03
HEIDELBERGER ZEMENT	DE0006047004	67.00	96.82		EUR	6 487	0.01
Mercedes-Benz Grp AG	DE0007100000	316.00	64.57		EUR	20 404	0.02
INFINEON TECHNOLOGIE	DE0006231004	183.00	34.31		EUR	6 278	0.01
VONOVIA SE	DE000A1ML7J1	509.00	26.55		EUR	13 514	0.01
DANONE	FR0000120644	148.00	57.08		EUR	8 448	0.01
AXA-UAP	FR0000120628	888.00	30.57		EUR	27 146	0.03
PERNOD RICARD	FR0000120693	101.00	126.70		EUR	12 797	0.01
TotalEnergies SE	FR0000120271	732.00	62.33		EUR	45 626	0.05
L OREAL	FR0000120321	77.00	410.05		EUR	31 574	0.03
BNP	FR0000131104	474.00	59.53		EUR	28 217	0.03
AIR LIQUIDE	FR0000120073	228.00	161.28		EUR	36 772	0.04
SCHNEIDER	FR0000121972	228.00	224.30		EUR	51 140	0.05

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2024-06-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
L.V.M.H.	FR0000121014	105.00	713.60		EUR	74 928	0.08
MICHELIN	FR001400AJ45	213.00	36.11		EUR	7 691	0.01
SAINT-GOBAIN	FR0000125007	213.00	72.62		EUR	15 468	0.02
THOMSON	FR0000121329	74.00	149.50		EUR	11 063	0.01
SOCIETE GENERALE	FR0000130809	581.00	21.92		EUR	12 736	0.01
CAP GEMINI SOGETI	FR0000125338	114.00	185.70		EUR	21 170	0.02
EssilorLuxottica	FR0000121667	90.00	201.20		EUR	18 108	0.02
GLE ENTREP. VINCI	FR0000125486	231.00	98.38		EUR	22 726	0.02
SANOFI SYNHLABO	FR0000120578	387.00	89.94		EUR	34 807	0.04
VEOLIA ENVIRONEMENT	FR0000124141	453.00	27.92		EUR	12 648	0.01
AIRBUS SE	NL0000235190	260.00	128.26		EUR	33 348	0.03
SAFRAN SA	FR0000073272	57.00	197.40		EUR	11 252	0.01
HERMES INTERNACIONAL	FR0000052292	14.00	2 140.00		EUR	29 960	0.03
AMUNDI SA	FR0004125920	171.00	60.25		EUR	10 303	0.01
SPIE SA	FR0012757854	218.00	33.78		EUR	7 364	0.01
CRH PLC	IE0001827041	208.00	58.96		GBP	14 469	0.01
RECKITT BENCKISER	GB00B24CGK77	117.00	42.82		GBP	5 911	0.01
OCADO GROUP PLC	GB00B3MBS747	742.00	2.89		GBP	2 529	0.00
ASHTREAD GROUP PLC	GB0000536739	106.00	52.82		GBP	6 606	0.01
AMADEUS HOLDING SA	ES0109067019	263.00	62.14		EUR	16 343	0.02
SHELL PLC-NEW	GB00BP6MXD84	218.00	33.60		EUR	7 324	0.01
BCO SANTANDER C.HISP	ES0113900J37	6 833.00	4.33		EUR	29 590	0.03
FERROVIAL SE	NL0015001FS8	281.00	36.26		EUR	10 189	0.01
INDITEX	ES0148396007	517.00	46.36		EUR	23 968	0.02
BANCO SABADELL SA	ES0113860A34	5 833.00	1.80		EUR	10 502	0.01
CAIXABANK SA	ES0140609019	4 130.00	4.94		EUR	20 415	0.02
CELLNEX TELECOM SAU	ES0105066007	370.00	30.37		EUR	11 237	0.01
Puig Brands SA	ES0105777017	490.00	26.10		EUR	12 789	0.01
UNICREDITO ITALIANO	IT0005239360	948.00	34.61		EUR	32 806	0.03
ENI SPA	IT0003132476	1 099.00	14.35		EUR	15 775	0.02
ENEL	IT0003128367	6 055.00	6.49		EUR	39 321	0.04
FINECOBANK SPA	IT0000072170	1 246.00	13.92		EUR	17 344	0.02
ESSITY AKTIEBO-B	SE0009922164	304.00	271.40		SEK	7 265	0.01
C.FIN.RICHMONT	CH0210483332	55.00	140.25		CHF	8 008	0.01
DSM-Firmenich AG	CH1216478797	126.00	105.60		EUR	13 306	0.01
KONINKLIJKE AHOLD NV	NL0011794037	324.00	27.59		EUR	8 939	0.01
ING GROEP NV	NL0011821202	1 807.00	15.96		EUR	28 843	0.03
ASML NA	NL0010273215	159.00	964.20		EUR	153 308	0.16
STELLANTIS NV	NL00150001Q9	1 063.00	18.47		EUR	19 634	0.02
FERRARI NV	NL0011585146	51.00	380.70		EUR	19 416	0.02

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2024-06-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
ASR NEDERLAND NV	NL0011872643	356.00	44.51		EUR	15 846	0.02
Prosus NV	NL0013654783	407.00	33.26		EUR	13 537	0.01
Adyen NV	NL0012969182	10.00	1 113.20		EUR	11 132	0.01
Universal Music Grp	NL0015000IY2	504.00	27.78		EUR	14 001	0.01
STMICROELECTRONICS	92110000110	415.00	36.87		EUR	15 299	0.02
Neste Oyj	FI0009013296	198.00	16.63		EUR	3 292	0.00
ERST BK DER OEST.SPA	AT0000652011	239.00	44.24		EUR	10 573	0.01
AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO						4 418 191	4.48
Schrd Euro Eq IZ€	LU2004793787	12 956.83	57.76		EUR	748 412	0.76
Amundi Eurl Eq-J2Ec	LU1883305259	572.05	2 345.03		EUR	1 341 470	1.36
Goldman Sachs-Q Eur	LU2639511745	127.27	5 696.95		EUR	725 034	0.74
iShares SMI Eq CHF	CH0008899764	2 630.00	124.98		CHF	341 252	0.35
iShares FTSE100 EqD	IE0005042456	71 928.00	7.94		GBP	673 702	0.68
Ishares € Mkt Grw	IE00B0M62V02	6 520.00	60.39		EUR	393 743	0.40
Lyxor Msciemu Grwt	LU1598688189	996.00	195.36		EUR	194 579	0.20
AÇÕES EMERGENTES						1 014 188	1.03
AÇÕES EMERGENTES - INV. INDIRETO						1 014 188	1.03
GS EmgMkt Eq I€Ac	LU1357028627	28 773.90	18.30		EUR	526 562	0.53
Wellington EM Eq €SA	LU2058844833	53 612.88	9.10		EUR	487 625	0.49
OBRIGAÇÕES						67 476 801	68.48
OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO						43 444 125	44.09
OBRIGAÇÕES GOVERNOS						13 537 075	13.74
OT 2.875% 07/2026	PTOTETOE0012	354 000.00	99.77%	9 621	EUR	362 789	0.37
OT 4.125% 04/2027	PTOTEUOE0019	246 000.00	103.27%	2 169	EUR	256 205	0.26
DBR 0.25% 02/27	DE0001102416	2 349 000.00	94.07%	2 198	EUR	2 211 973	2.24
DBR 0.25% 08/2028	DE0001102457	546 000.00	91.44%	1 197	EUR	500 460	0.51
FRTR 0% 02/2027	FR0014003513	2 440 000.00	92.28%		EUR	2 251 583	2.29
FRTR 2,75% 02/2029	FR001400HI98	993 000.00	98.75%	9 476	EUR	990 083	1.00
SPGB 1.4% 07/28	ES0000012B88	1 229 000.00	93.85%	15 843	EUR	1 169 247	1.19
SPGB 0% 01/2026	ES0000012G91	792 000.00	95.16%		EUR	753 643	0.76
BTPS 0% 08/2026	IT0005454241	2 136 000.00	93.25%		EUR	1 991 820	2.02
BTPS 0,5% 07/2028	IT0005445306	925 000.00	89.06%	2 135	EUR	825 940	0.84
NETHER 0.75% 07/27	NL0012171458	552 000.00	94.28%	3 982	EUR	524 413	0.53
RFGB 1,375% 04/2027	FI4000527551	238 000.00	95.83%	690	EUR	228 761	0.23
BGB 0.8% 06/27	BE0000341504	876 000.00	94.21%	173	EUR	825 409	0.84
RAGB 0,5% 04/2027	AT0000A1VGK0	543 000.00	93.37%	536	EUR	507 546	0.52
IRISH 0.9% 05/28	IE00BDHDPR44	147 000.00	93.22%	170	EUR	137 204	0.14
OBRIGAÇÕES CRÉDITO						29 907 050	30.35
GALPPL 2% 01/2026	PTGALCOM0013	500 000.00	97.02%	4 590	EUR	489 700	0.50
BCPPL 1.125% 02/2027	PTBCPHOM0066	300 000.00	95.26%	1 291	EUR	287 062	0.29

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2024-06-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
FIDELI 4.25% 09/2031	PTFIDBOM0009	500 000.00	96.50%	17 476	EUR	499 991	0.51
CXGD 0.375% 09/2027	PTCGDCOM0037	500 000.00	92.70%	1 455	EUR	464 940	0.47
CRLPL 2.5% 11/2026	PTCCCAOM0000	500 000.00	97.00%	8 163	EUR	493 153	0.50
FLOEPT 4,875% 07/28	PTGGDDOM0008	500 000.00	102.39%	24 242	EUR	536 182	0.54
NOVBNC 4,25% 03/2028	PTNOBIOM0006	500 000.00	99.95%	6 695	EUR	506 465	0.51
FIDELI 7 3/4 PERP	PTFIDAOM0000	200 000.00	98.49%	1 390	EUR	198 364	0.20
MRKGR 1.625% 06/2079	XS2011260531	500 000.00	98.54%	4 351	EUR	497 041	0.50
DB 1% 11/2025	DE000DL19VR6	300 000.00	98.84%	1 844	EUR	298 352	0.30
VW 0.125% 02/2027	XS2374595044	500 000.00	91.40%	239	EUR	457 259	0.46
LEGGR 0.875% 11/2027	DE000A254P51	500 000.00	91.50%	2 582	EUR	460 057	0.47
IFXGR 3,375% 02/2027	XS2767979052	400 000.00	99.78%	4 648	EUR	403 780	0.41
ULFP 1% 02/2027	FR0013405032	400 000.00	93.39%	1 366	EUR	374 922	0.38
BNP 0.25% 04/2027	FR0014002X43	400 000.00	93.84%	216	EUR	375 588	0.38
CAFP 4,125% 10/2028	FR001400D0F9	500 000.00	101.68%	14 821	EUR	523 201	0.53
BFCM 4,125% 03/2029	FR001400GGZ0	300 000.00	101.88%	3 729	EUR	309 372	0.31
ACAFP 3,875% 04/2031	FR001400HCR4	200 000.00	100.94%	1 529	EUR	203 411	0.21
ENGIFP 3,875% 01/31	FR001400KHG0	500 000.00	100.54%	9 370	EUR	512 050	0.52
AKEFP 4,25% 05/2030	FR001400M2R9	500 000.00	102.47%	2 445	EUR	514 800	0.52
RENAUL 4,875% 10/29	FR001400KY69	500 000.00	103.44%	18 181	EUR	535 386	0.54
BPLN 3.25% PERP	XS2193661324	500 000.00	97.57%	401	EUR	488 251	0.50
NWG 1.375% 03/2027	XS2449911143	500 000.00	94.53%	2 279	EUR	474 914	0.48
CEPSA 1% 02/2025	XS1996435688	100 000.00	98.18%	372	EUR	98 554	0.10
BKIASM 1.125% 11/26	ES0213307061	400 000.00	94.18%	2 852	EUR	379 552	0.39
BKTSM 0.625% 10/2027	ES0213679JR9	300 000.00	90.67%	1 378	EUR	273 379	0.28
CLNXSM 0.75% 11/2026	XS2300292617	500 000.00	93.41%	2 346	EUR	469 411	0.48
UCAJLN 4.5% 06/2025	ES0380907057		100.00%	25	EUR	25	0.00
SABSM 5.125% 11/2028	XS2553801502	500 000.00	104.19%	16 383	EUR	537 328	0.55
KUTXAB 4% 02/2028	ES0343307023	400 000.00	100.73%	6 601	EUR	409 521	0.42
ABANCA 5,875% 04/30	ES0265936056	300 000.00	106.76%	4 346	EUR	324 611	0.33
EDPPL 4,125% 04/2029	XS2699159278	500 000.00	101.85%	4 973	EUR	514 243	0.52
ABESM 2,25% 03/2029	XS2195092601	500 000.00	93.77%	2 897	EUR	471 762	0.48
SWEDA 4,375% 09/2030	XS2676305779	500 000.00	103.08%	17 930	EUR	533 315	0.54
UCGIM 5.85% 11/2027	XS2555420103	300 000.00	104.31%	10 981	EUR	323 911	0.33
CMCSA 0.25% 05/2027	XS2114852218	300 000.00	91.46%	86	EUR	274 469	0.28
DOW 0.5% 03/2027	XS2122485845	400 000.00	92.00%	592	EUR	368 596	0.37
MS 0.406% 10/2027	XS2338643740	400 000.00	92.82%	1 092	EUR	372 368	0.38
DLR 2.5% 01/2026	XS1891174341	500 000.00	97.62%	5 704	EUR	493 809	0.50
JPM 0.389% 02/2028	XS2123320033	500 000.00	91.92%	680	EUR	460 275	0.47
MS 4.813% 10/2028	XS2548080832	500 000.00	103.49%	16 438	EUR	533 898	0.54
VFC 4,25% 03/2029	XS2592659671	500 000.00	96.03%	6 753	EUR	486 878	0.49

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2024-06-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
MCD 4% 03/2030	XS2595418166	400 000.00	102.24%	5 085	EUR	414 029	0.42
BAC 4,134% 06/2028	XS2634687912	300 000.00	101.96%	646	EUR	306 517	0.31
GE 1,5% 05/2029	XS1612543121	500 000.00	91.40%	925	EUR	457 925	0.46
T 2,6% 12/2029	XS1144088165	500 000.00	94.85%	6 997	EUR	481 232	0.49
FIS 1% 12/2028	XS2085655590	500 000.00	89.12%	2 883	EUR	448 503	0.46
BKNG 3,5% 03/2029	XS2776511060	300 000.00	100.03%	3 510	EUR	303 609	0.31
KHC 3,5% 03/2029	XS2776793965	500 000.00	99.78%	5 178	EUR	504 058	0.51
JEF 4% 04/2029	XS2801963716	500 000.00	99.31%	4 164	EUR	500 714	0.51
NIBCAP 0.875% 07/25	XS2023631489	500 000.00	96.95%	4 291	EUR	489 026	0.50
REPSM 0.25% 08/2027	XS2035620710	200 000.00	90.56%	456	EUR	181 572	0.18
ANNGR 1.5% 06/2026	DE000A182VT2	500 000.00	95.55%	432	EUR	478 187	0.49
INTNED 1.25% 02/27	XS2443920249	500 000.00	96.03%	2 322	EUR	482 467	0.49
VW 4.25% 02/2028	XS2554488978	500 000.00	101.66%	7 954	EUR	516 249	0.52
INTNED 4.875% 11/27	XS2554746185	500 000.00	102.38%	15 318	EUR	527 213	0.54
RABOBK 4,233% 04/29	XS2613658041	300 000.00	102.03%	2 331	EUR	308 409	0.31
SIEGR 1,375% 09/2030	XS1874127902	500 000.00	90.18%	5 616	EUR	456 531	0.46
SDZSW 4,22% 04/2030	XS2715940891	500 000.00	101.95%	4 336	EUR	514 101	0.52
MBGGR 3% 07/2027	DE000A3LSYG8	300 000.00	98.98%	4 254	EUR	301 182	0.31
ENELIM 3.375% 07/28	XS2751666426	300 000.00	99.03%	4 438	EUR	301 537	0.31
CARLB 0.375% 06/2027	XS2191509038	400 000.00	91.06%	4	EUR	364 224	0.37
NYKRE 4,625% 01/2029	DK0030512421	500 000.00	103.24%	10 362	EUR	526 562	0.53
DNBNO 4,625% 11/2029	XS2698148702	500 000.00	103.59%	15 353	EUR	533 278	0.54
NESVFH 0.75% 03/2028	FI4000496286	500 000.00	89.78%	1 007	EUR	449 882	0.46
NDAFH 0,625% 08/2031	XS2343459074	400 000.00	93.47%	2 172	EUR	376 036	0.38
ARNDTN 0.375 04/2027	XS2421195848	400 000.00	86.59%	316	EUR	346 676	0.35
TRAGR 4.125% 11/2025	DE000A3LBGG1	200 000.00	100.17%	5 004	EUR	205 336	0.21
BDX 3,553% 09/2029	XS2585932275	500 000.00	99.55%	14 173	EUR	511 938	0.52
TACHEM 2.25% 11/2026	XS1843449122	400 000.00	97.07%	5 484	EUR	393 752	0.40
ANZ 1.125% 11/21/29	XS2082818951	500 000.00	98.64%	3 427	EUR	496 607	0.50
BNS 3,5% 04/2029	XS2804565435	500 000.00	99.19%	3 596	EUR	499 551	0.51
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO						24 032 676	24.39
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO - GOVERNOS						24 032 676	24.39
JPM Eur Gvt Bd I	LU0355584201	7 427.13	114.44		EUR	849 990	0.86
BlueBay Eur GvtBd Q	LU1170327958	11 418.84	102.91		EUR	1 175 112	1.19
iShares Eur GvtBd I	IE00B4WXJJ64	120 644.00	109.45		EUR	13 204 486	13.40
Xtrack US TSY €Hd	LU1399300455	95 150.00	92.52		EUR	8 803 088	8.93
ALTERNATIVOS						923 262	0.94
CAIXA PRIVATE EQUITY	PTYME4LE0005	40 509.00	6.89		EUR	278 973	0.28
CAIXA INFRAESTRUTURA	PTYME7LE0002	82 413.00	7.82		EUR	644 288	0.65
IMOBILIÁRIO						17 616 145	17.88

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2024-06-30

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

IMOBILIÁRIO > IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO						5 563 000	5.65
REPUBLICA 35- R/C	P50040000002	8.00			EUR	5 563 000	5.65
IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO						12 053 145	12.23
CXG IMOBILIARIO	PTYMESHE0009	710 909.00	3.86		EUR	2 742 900	2.78
Fundimo	PTYCXTHM0007	1 088 472.00	8.55		EUR	9 310 245	9.45
LIQUIDEZ						2 396 944	2.43
TOTAL						98 534 851	100.00

Saldos de Unidades de Participação

	Peso (%)	Valor (EUR)
Valor (EUR)	100.00	98 534 851.110000
Quantidade		7 148 711.338859
Cotação 2024-07-01 (EUR)		13.783600

Câmbios

CHF / EUR	1.038195
DKK / EUR	0.134091
EUR / EUR	1.000000
GBP / EUR	1.179788
NOK / EUR	0.087558
SEK / EUR	0.088054
USD / EUR	0.933620