

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-07-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
AÇÕES						11 118 852	10.73
AÇÕES EUA						2 340 074	2.26
AÇÕES EUA - INV. DIRETO						33 913	0.03
ESU3 S&P500 09/23	91004070057	3.00	4 609.50		USD	0	0.00
STELLANTIS NV	NL00150001Q9	1 819.00	18.64		EUR	33 913	0.03
AÇÕES EUA - INV. INDIRETO						2 306 160	2.22
TRowe US BlueCp €I	LU1136108674	33 430.88	30.60		EUR	1 022 985	0.99
MorganS US Advt Z\$	LU0360484686	4 898.74	114.75		USD	510 147	0.49
iShares SP500 Value	US4642874089	5 113.00	166.60		USD	773 029	0.75
AÇÕES ÁSIA						1 022 225	0.99
AÇÕES ÁSIA - INV. INDIRETO						1 022 225	0.99
TRowe Japan Eq I€A	LU2444288430	106 370.99	9.61		EUR	1 022 225	0.99
AÇÕES EUROPEIAS						6 636 069	6.40
AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO						1 784 070	1.72
EDP Renováveis	ES0127797019	798.00	17.37		EUR	13 861	0.01
VGU3 EUR EUX 09/23	DE000C1TL5V9	13.00	4 492.00		EUR	0	0.00
BMW	DE0005190003	150.00	110.86		EUR	16 629	0.02
COMMERZBANK	DE000CBK1001	1 102.00	10.88		EUR	11 984	0.01
SIEMENS	DE0007236101	422.00	154.98		EUR	65 402	0.06
ALLIANZ	DE0008404005	118.00	217.40		EUR	25 653	0.02
BASF	DE000BASF111	546.00	48.77		EUR	26 628	0.03
BAYER AG	DE000BAY0017	494.00	53.14		EUR	26 251	0.03
RWE-RHEINISCH WEST..	DE0007037129	301.00	39.13		EUR	11 778	0.01
ADIDAS- SALOMON AG	DE000A1EWWW0	129.00	184.00		EUR	23 736	0.02
MERCK KGAA	DE0006599905	64.00	159.80		EUR	10 227	0.01
SAP SE	DE0007164600	351.00	124.40		EUR	43 664	0.04
DEUTSCHE TELEKOM	DE0005557508	2 046.00	19.84		EUR	40 597	0.04
Mercedes-Benz Grp AG	DE0007100000	418.00	72.64		EUR	30 364	0.03
INFINEON TECHNOLOGIE	DE0006231004	563.00	40.00		EUR	22 520	0.02
DEUTSCHE POST	DE0005552004	546.00	46.72		EUR	25 509	0.02
DEUTSCHE BOERSE AG	DE0005810055	72.00	174.30		EUR	12 550	0.01
VONOVIA SE	DE000A1ML7J1	675.00	21.24		EUR	14 337	0.01
DANONE	FR0000120644	196.00	55.53		EUR	10 884	0.01
AXA-UAP	FR0000120628	1 177.00	27.97		EUR	32 921	0.03
CARREFOUR	FR0000120172	579.00	18.19		EUR	10 532	0.01
PERNOD RICARD	FR0000120693	129.00	200.60		EUR	25 877	0.02
TotalEnergies SE	FR0000120271	970.00	55.26		EUR	53 602	0.05
L OREAL	FR0000120321	112.00	423.20		EUR	47 398	0.05

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-07-31

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	523.60		EUR	9 948	0.01
BNP	FR0000131104	289.00	60.02		EUR	17 346	0.02
AIR LIQUIDE	FR0000120073	267.00	163.36		EUR	43 617	0.04
SCHNEIDER	FR0000121972	185.00	162.04		EUR	29 977	0.03
L.V.M.H.	FR0000121014	132.00	848.10		EUR	111 949	0.11
MICHELIN	FR001400AJ45	522.00	29.77		EUR	15 540	0.01
SAINT-GOBAIN	FR0000125007	445.00	61.48		EUR	27 359	0.03
THOMSON	FR0000121329	97.00	135.95		EUR	13 187	0.01
SOCIETE GENERALE	FR0000130809	1 040.00	24.72		EUR	25 704	0.02
CAP GEMINI SOGETI	FR0000125338	150.00	164.85		EUR	24 728	0.02
EssilorLuxottica	FR0000121667	120.00	182.94		EUR	21 953	0.02
GLE ENTREP. VINCI	FR0000125486	256.00	106.78		EUR	27 336	0.03
SANOFI SYNHLABO	FR0000120578	456.00	97.09		EUR	44 273	0.04
VEOLIA ENVIRONEMENT	FR0000124141	400.00	29.60		EUR	11 840	0.01
AIRBUS SE	NL0000235190	344.00	133.98		EUR	46 089	0.04
SAFRAN SA	FR0000073272	75.00	150.96		EUR	11 322	0.01
HERMES INTERNACIONAL	FR0000052292	19.00	2 016.50		EUR	38 314	0.04
TELEPERFORMANCE	FR0000051807	47.00	131.75		EUR	6 192	0.01
RECKITT BENCKISER	GB00B24CGK77	155.00	58.38		GBP	10 557	0.01
OCADO GROUP PLC	GB00B3MBS747	1 379.00	9.38		GBP	15 097	0.01
GLENCORE PLC	JE00B4T3BW64	1 497.00	4.74		GBP	8 271	0.01
ASHTREAD GROUP PLC	GB0000536739	140.00	57.62		GBP	9 411	0.01
AMADEUS HOLDING SA	ES0109067019	349.00	65.22		EUR	22 762	0.02
SHELL PLC-NEW	GB00BP6MXD84	289.00	27.99		EUR	8 088	0.01
TELEFONICA	ES0178430E18	3 642.00	3.88		EUR	14 120	0.01
BCO SANTANDER C.HISP	ES0113900J37	9 054.00	3.68		EUR	33 350	0.03
FERROVIAL SE	NL0015001FS8	373.00	30.14		EUR	11 242	0.01
INDITEX	ES0148396007	685.00	34.81		EUR	23 845	0.02
BANCO SABADELL SA	ES0113860A34	12 341.00	1.12		EUR	13 810	0.01
CAIXABANK SA	ES0140609019	5 472.00	3.67		EUR	20 077	0.02
CELLNEX TELECOM SAU	ES0105066007	308.00	37.14		EUR	11 439	0.01
UNICREDITO ITALIANO	IT0005239360	1 858.00	23.00		EUR	42 734	0.04
ENI SPA	IT0003132476	1 456.00	13.88		EUR	20 215	0.02
ENEL	IT0003128367	5 400.00	6.27		EUR	33 869	0.03
FINECOBANK SPA	IT0000072170	1 651.00	14.12		EUR	23 304	0.02
TELE2 AB - B SHS	SE0005190238	639.00	79.22		SEK	4 375	0.00
ESSITY AKTIEBO-B	SE0009922164	312.00	260.90		SEK	7 034	0.01
C.FIN.RICHMONT	CH0210483332	73.00	140.30		CHF	10 697	0.01
DSM-Firmenich AG	CH1216478797	92.00	100.50		EUR	9 246	0.01
KONINKLIJKE AHOLD NV	NL0011794037	409.00	31.39		EUR	12 836	0.01

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-07-31

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	13.28		EUR	35 444	0.03
KONINKLIJKE PHILIPS	NL0000009538	578.00	18.91		EUR	10 929	0.01
ASML NA	NL0010273215	210.00	652.20		EUR	136 962	0.13
ASR NEDERLAND NV	NL0011872643	245.00	41.29		EUR	10 116	0.01
Prosus NV	NL0013654783	248.00	72.03		EUR	17 863	0.02
STMicroelectronics	92110000110	294.00	48.63		EUR	14 296	0.01
SAMPO OYJ-A SHS	FI0009003305	218.00	40.09		EUR	8 740	0.01
Neste Oyj	FI0009013296	262.00	33.46		EUR	8 767	0.01
ERST BK DER OEST.SPA	AT0000652011	483.00	34.38		EUR	16 606	0.02
CRH ORD	IE0001827041	524.00	54.18		EUR	28 390	0.03
AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO						4 851 999	4.68
ING(L) INV EUR HDVD	LU0191250090	781.12	935.42		EUR	730 676	0.70
ALZ EuroInd EqGwt WT	LU0852482198	319.83	2 312.68		EUR	739 662	0.71
Schrd Euro Eq IZ€	LU2004793787	20 350.91	53.66		EUR	1 091 955	1.05
Amundi Eurl Eq-J2Ec	LU1883305259	517.23	2 130.69		EUR	1 102 046	1.06
iShares SMI Eq CHF	CH0008899764	3 236.00	117.26		CHF	396 321	0.38
iShares FTSE100 EqD	IE0005042456	90 270.00	7.51		GBP	791 340	0.76
AÇÕES EMERGENTES						1 120 484	1.08
AÇÕES EMERGENTES - INV. INDIRETO						1 120 484	1.08
GS EmgMkt Eq I€Ac	LU1357028627	32 873.90	16.80		EUR	552 282	0.53
Wellington EM Eq €SA	LU2058844833	67 080.17	8.47		EUR	568 203	0.55
OBRIGAÇÕES						71 684 105	69.15
OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO						47 216 380	45.55
OBRIGAÇÕES GOVERNOS						15 270 438	14.73
OT 2.875% 07/2026	PTOTETOE0012	253 000.00	99.81%	219	EUR	252 738	0.24
DBR 0.25% 02/27	DE0001102416	2 606 000.00	91.95%	2 981	EUR	2 399 224	2.31
OBL 0% 10/2024	DE0001141802	715 000.00	96.08%		EUR	686 936	0.66
FRTR 0% 03/2025	FR0013415627	909 000.00	94.84%		EUR	862 087	0.83
FRTR 0% 02/2027	FR0014003513	2 964 000.00	90.15%		EUR	2 672 046	2.58
SPGB 0% 01/2027	ES0000012J15	1 234 000.00	89.39%		EUR	1 103 011	1.06
SPGB 0% 01/2026	ES0000012G91	1 068 000.00	92.17%		EUR	984 354	0.95
BTPS 0% 08/2026	IT0005454241	3 502 000.00	89.98%		EUR	3 150 925	3.04
BTPS 0% 12/2024	IT0005474330	378 000.00	95.21%		EUR	359 890	0.35
NETHER 0.75% 07/27	NL0012171458	594 000.00	92.37%	207	EUR	548 897	0.53
RFGB 0% 09/2026	FI4000511449	299 000.00	91.03%		EUR	272 180	0.26
BGB 1% 06/2026	BE0000337460	1 322 000.00	94.45%	1 445	EUR	1 250 087	1.21
RAGB 0.75% 10/26	AT0000A1K9C8	532 000.00	93.15%	3 115	EUR	498 695	0.48
IRISH 1% 05/2026	IE00BV8C9418	241 000.00	94.96%	514	EUR	229 370	0.22
OBRIGAÇÕES CRÉDITO						31 945 943	30.82
GALPPL 2% 01/2026	PTGALCOM0013	500 000.00	94.00%	5 425	EUR	475 405	0.46

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-07-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
BCPPL 1.125% 02/2027	PTBCPHOM0066	600 000.00	88.46%	3 144	EUR	533 922	0.52
FIDELI 4.25% 09/2031	PTFIDBOM0009	500 000.00	86.16%	19 271	EUR	450 066	0.43
CXGD 0.375% 09/2027	PTCGDCOM0037	700 000.00	88.24%	2 258	EUR	619 945	0.60
CRLPL 2.5% 11/2026	PTCCCAOM0000	500 000.00	89.37%	9 212	EUR	456 067	0.44
FLOEPT 4,875% 07/28	PTGGDDOM0008	500 000.00	100.18%	1 931	EUR	502 846	0.49
MRKGR 1.625% 06/2079	XS2011260531	500 000.00	95.35%	5 031	EUR	481 771	0.46
DB 1% 11/2025	DE000DL19VR6	500 000.00	95.15%	3 493	EUR	479 248	0.46
NRPBBGR 0.1% 02/2026	DE000A3H2ZX9	700 000.00	88.13%	345	EUR	617 241	0.60
VW 0.125% 02/2027	XS2374595044	500 000.00	87.34%	291	EUR	436 986	0.42
LEGGR 0.875% 11/2027	DE000A254P51	500 000.00	86.01%	2 949	EUR	432 994	0.42
BAYNGR 4,25% 08/2029	XS2630112014	300 000.00	100.80%	2 340	EUR	304 743	0.29
ULFP 1% 02/2027	FR0013405032	600 000.00	89.55%	2 548	EUR	539 824	0.52
BPCEGP 0.625% 09/24	FR0013429073	500 000.00	96.15%	2 646	EUR	483 391	0.47
BNP 0.25% 04/2027	FR0014002X43	600 000.00	89.53%	451	EUR	537 601	0.52
BFCM 4,125% 03/2029	FR001400GGZ0	500 000.00	100.54%	7 946	EUR	510 656	0.49
ACAFP 3,875% 04/2031	FR001400HCR4	500 000.00	99.52%	5 453	EUR	503 063	0.49
HSBC 1.5% 12/2024	XS1917601582	500 000.00	99.12%	4 932	EUR	500 542	0.48
LLOYDS 0.375% 01/25	XS2109394077	500 000.00	94.53%	950	EUR	473 585	0.46
BPLN 3.25% PERP	XS2193661324	500 000.00	93.43%	1 776	EUR	468 906	0.45
VMUKLN 2.875% 06/25	XS2126084750	500 000.00	97.22%	1 492	EUR	487 612	0.47
NWG 1.375% 03/2027	XS2449911143	500 000.00	90.67%	2 855	EUR	456 215	0.44
CEPSA 1% 02/2025	XS1996435688	500 000.00	94.94%	2 274	EUR	476 949	0.46
BKIASM 1.125% 11/26	ES0213307061	600 000.00	90.30%	4 845	EUR	546 621	0.53
SANSCF 0.375% 01/25	XS2100690036	500 000.00	94.85%	1 007	EUR	475 277	0.46
BKTSM 0.625% 10/2027	ES0213679JR9	600 000.00	86.82%	3 072	EUR	523 998	0.51
CLNXSM 0.75% 11/2026	XS2300292617	500 000.00	89.11%	2 661	EUR	448 226	0.43
UCAJLN 4.5% 06/2025	ES0380907057	500 000.00	99.56%	1 967	EUR	499 772	0.48
SABSM 5.125% 11/2028	XS2553801502	500 000.00	102.18%	18 534	EUR	529 434	0.51
KUTXAB 4% 02/2028	ES0343307023	400 000.00	98.63%	7 934	EUR	402 466	0.39
SWEDA 0.25% 10/2024	XS2063261155	500 000.00	95.59%	1 014	EUR	478 959	0.46
SEB 4% 11/2026	XS2553798443	500 000.00	99.41%	14 521	EUR	511 591	0.49
SWEDA 4,25% 07/2028	XS2572496623	500 000.00	100.00%	1 219	EUR	501 234	0.48
ISPIM 1% 07/2024	XS2022425297	500 000.00	97.20%	383	EUR	486 368	0.47
UCGIM 5.85% 11/2027	XS2555420103	500 000.00	104.06%	20 755	EUR	541 050	0.52
EMR 0.375% 05/2024	XS1999902502	500 000.00	97.14%	364	EUR	486 054	0.47
JEF 1% 07/2024	XS2030530450	500 000.00	96.62%	178	EUR	483 293	0.47
BAC 1.379% 02/2025	XS1560863802	600 000.00	98.47%	3 967	EUR	594 787	0.57
MS 0.406% 10/2027	XS2338643740	600 000.00	88.39%	1 842	EUR	532 176	0.51
DLR 2.5% 01/2026	XS1891174341	500 000.00	94.61%	6 747	EUR	479 792	0.46
C 2.125% 09/2026	XS1107727007	500 000.00	94.89%	9 461	EUR	483 926	0.47

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-07-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
JPM 0.389% 02/2028	XS2123320033	500 000.00	87.86%	842	EUR	440 127	0.42
MS 4.813% 10/2028	XS2548080832	500 000.00	101.85%	18 461	EUR	527 721	0.51
VFC 4,25% 03/2029	XS2592659671	500 000.00	98.82%	8 535	EUR	502 645	0.48
MCD 4% 03/2030	XS2595418166	400 000.00	101.85%	6 426	EUR	413 826	0.40
BAC 4,134% 06/2028	XS2634687912	500 000.00	99.92%	2 824	EUR	502 419	0.48
NIBCAP 0.875% 07/25	XS2023631489	500 000.00	91.98%	287	EUR	460 197	0.44
REPSM 0.25% 08/2027	XS2035620710	200 000.00	87.50%	499	EUR	175 507	0.17
ANNGR 1.5% 06/2026	DE000A182VT2	500 000.00	92.57%	1 066	EUR	463 911	0.45
INTNED 1.25% 02/27	XS2443920249	500 000.00	92.54%	2 842	EUR	465 552	0.45
VW 4.25% 02/2028	XS2554488978	500 000.00	99.87%	9 723	EUR	509 083	0.49
INTNED 4.875% 11/27	XS2554746185	500 000.00	101.67%	17 363	EUR	525 718	0.51
TOYOTA 3,5% 01/2028	XS2572989817	400 000.00	98.84%	7 671	EUR	403 015	0.39
SIENFI 4,25% 04/2029	XS2601459162	300 000.00	98.11%	4 111	EUR	298 450	0.29
RABOBK 4,233% 04/29	XS2613658041	500 000.00	99.68%	5 667	EUR	504 042	0.49
NYKRE 0.75% 01/2027	DK0009526998	500 000.00	88.18%	1 983	EUR	442 903	0.43
CARLB 0.375% 06/2027	XS2191509038	400 000.00	87.73%	131	EUR	351 047	0.34
SYDBDC 4.75% 09/2025	XS2538445581	500 000.00	99.31%	19 846	EUR	516 391	0.50
SPOLNO 0.25% 09/2024	XS2057872595	500 000.00	95.24%	1 045	EUR	477 250	0.46
NESVFH 0.75% 03/2028	FI4000496286	500 000.00	86.71%	1 322	EUR	434 882	0.42
RBIAB 0.25% 01/2025	XS2106056653	600 000.00	93.48%	785	EUR	561 659	0.54
TRAGR 4.125% 11/2025	DE000A3LBGG1	500 000.00	99.29%	14 240	EUR	510 670	0.49
SUMIBK 1.413 06/27	XS1621087516	600 000.00	91.07%	1 112	EUR	547 532	0.53
TACHEM 2.25% 11/2026	XS1843449122	500 000.00	95.15%	7 798	EUR	483 533	0.47
MUFG 0.339% 07/2024	XS2028899727	100 000.00	96.58%	12	EUR	96 593	0.09
ANZ 1.125% 11/21/29	XS2082818951	500 000.00	94.36%	3 899	EUR	475 709	0.46
ALVGR Var 4.75%10/23	DE000A1YCQ29	600 000.00	99.84%	21 941	EUR	620 963	0.60
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO						24 467 725	23.60
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO - GOVERNOS						24 467 725	23.60
JPM Eur Gvt Bd I	LU0355584201	7 678.13	110.95		EUR	851 919	0.82
BlueBay Eur GvtBd Q	LU1170327958	12 869.01	99.35		EUR	1 278 536	1.23
iShares Eur GvtBd I	IE00B4WXJJ64	134 166.00	107.50		EUR	14 422 174	13.91
Xtrack US TSY €Hd	LU1399300455	83 058.00	95.30		EUR	7 915 095	7.64
ALTERNATIVOS						916 259	0.88
CAIXA PRIVATE EQUITY	PTYME4LE0005	40 509.00	6.32		EUR	256 074	0.25
CAIXA INFRAESTRUTURA	PTYME7LE0002	82 413.00	8.01		EUR	660 186	0.64
IMOBILIÁRIO						17 035 495	16.43
IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO						4 966 000	4.79
REPUBLICA 35- R/C	P50040000002	8.00			EUR	4 966 000	4.79
IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO						12 069 495	11.64
CXG IMOBILIARIO	PTYMESHE0009	710 909.00	4.18		EUR	2 969 325	2.86

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-07-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

IMOBILIÁRIO > IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
Fundimo	PTYCXTHM0007	1 088 472.00	8.36		EUR	9 100 170	8.78
LIQUIDEZ						2 913 156	2.81
TOTAL						103 667 868	100.00

Saldos de Unidades de Participação

	Peso (%)	Valor (EUR)
Valor (EUR)	100.00	103 667 867.590000
Quantidade		7 811 564.055899
Cotação 2023-08-01 (EUR)		13.271100

Câmbios

CHF / EUR	1.044452
DKK / EUR	0.134183
EUR / EUR	1.000000
GBP / EUR	1.166671
NOK / EUR	0.089718
SEK / EUR	0.086418
USD / EUR	0.907523