

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-08-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
AÇÕES						10 761 947	10.55
AÇÕES EUA						2 290 328	2.25
AÇÕES EUA - INV. DIRETO						31 243	0.03
ESU3 S&P500 09/23	91004070057	3.00	4 523.25		USD	0	0.00
STELLANTIS NV	NL00150001Q9	1 819.00	17.18		EUR	31 243	0.03
AÇÕES EUA - INV. INDIRETO						2 259 085	2.21
TRowe US BlueCp €I	LU1136108674	33 430.88	30.78		EUR	1 029 002	1.01
MorganS US Advt Z\$	LU0360484686	4 898.74	102.40		USD	462 802	0.45
iShares SP500 Value	US4642874089	5 113.00	162.66		USD	767 280	0.75
AÇÕES ÁSIA						967 976	0.95
AÇÕES ÁSIA - INV. INDIRETO						967 976	0.95
TRowe Japan Eq I€A	LU2444288430	106 370.99	9.10		EUR	967 976	0.95
AÇÕES EUROPEIAS						6 429 749	6.30
AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO						1 720 496	1.69
EDP Renováveis	ES0127797019	798.00	16.91		EUR	13 490	0.01
VGU3 EUR EUX 09/23	DE000C1TL5V9	13.00	4 300.00		EUR	0	0.00
BMW	DE0005190003	150.00	97.17		EUR	14 576	0.01
COMMERZBANK	DE000CBK1001	1 102.00	10.15		EUR	11 185	0.01
SIEMENS	DE0007236101	422.00	138.88		EUR	58 607	0.06
ALLIANZ	DE0008404005	118.00	224.35		EUR	26 473	0.03
BASF	DE000BASF111	546.00	46.79		EUR	25 547	0.03
BAYER AG	DE000BAY0017	494.00	50.54		EUR	24 967	0.02
RWE-RHEINISCH WEST..	DE0007037129	301.00	38.06		EUR	11 456	0.01
ADIDAS- SALOMON AG	DE000A1EWWW0	129.00	184.42		EUR	23 790	0.02
MERCK KGAA	DE0006599905	64.00	166.00		EUR	10 624	0.01
SAP SE	DE0007164600	351.00	128.82		EUR	45 216	0.04
DEUTSCHE TELEKOM	DE0005557508	2 046.00	19.74		EUR	40 392	0.04
Mercedes-Benz Grp AG	DE0007100000	418.00	67.54		EUR	28 232	0.03
INFINEON TECHNOLOGIE	DE0006231004	563.00	33.02		EUR	18 587	0.02
DEUTSCHE POST	DE0005552004	546.00	43.09		EUR	23 524	0.02
DEUTSCHE BOERSE AG	DE0005810055	72.00	163.85		EUR	11 797	0.01
VONOVIA SE	DE000A1ML7J1	675.00	22.11		EUR	14 924	0.01
DANONE	FR0000120644	196.00	53.83		EUR	10 551	0.01
AXA-UAP	FR0000120628	1 177.00	27.78		EUR	32 691	0.03
CARREFOUR	FR0000120172	579.00	17.67		EUR	10 231	0.01
PERNOD RICARD	FR0000120693	134.00	181.20		EUR	24 281	0.02
TotalEnergies SE	FR0000120271	970.00	58.07		EUR	56 328	0.06
L OREAL	FR0000120321	112.00	405.80		EUR	45 450	0.04

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-08-31

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	494.20		EUR	9 390	0.01
BNP	FR0000131104	289.00	59.71		EUR	17 256	0.02
AIR LIQUIDE	FR0000120073	267.00	166.86		EUR	44 552	0.04
SCHNEIDER	FR0000121972	185.00	158.58		EUR	29 337	0.03
L.V.M.H.	FR0000121014	132.00	782.20		EUR	103 250	0.10
MICHELIN	FR001400AJ45	522.00	28.91		EUR	15 091	0.01
SAINT-GOBAIN	FR0000125007	445.00	60.16		EUR	26 771	0.03
THOMSON	FR0000121329	97.00	134.80		EUR	13 076	0.01
SOCIETE GENERALE	FR0000130809	770.00	26.22		EUR	20 186	0.02
CAP GEMINI SOGETI	FR0000125338	150.00	172.35		EUR	25 853	0.03
EssilorLuxottica	FR0000121667	120.00	173.90		EUR	20 868	0.02
GLE ENTREP. VINCI	FR0000125486	256.00	102.96		EUR	26 358	0.03
SANOFI SYNHLABO	FR0000120578	456.00	98.64		EUR	44 980	0.04
VEOLIA ENVIRONEMENT	FR0000124141	400.00	28.86		EUR	11 544	0.01
AIRBUS SE	NL0000235190	344.00	135.38		EUR	46 571	0.05
SAFRAN SA	FR0000073272	75.00	148.30		EUR	11 123	0.01
HERMES INTERNACIONAL	FR0000052292	19.00	1 900.80		EUR	36 115	0.04
TELEPERFORMANCE	FR0000051807	47.00	127.85		EUR	6 009	0.01
RECKITT BENCKISER	GB00B24CGK77	155.00	57.02		GBP	10 327	0.01
OCADO GROUP PLC	GB00B3MBS747	983.00	8.72		GBP	10 011	0.01
GLENCORE PLC	JE00B4T3BW64	1 497.00	4.21		GBP	7 372	0.01
ASHTREAD GROUP PLC	GB0000536739	140.00	55.24		GBP	9 036	0.01
AMADEUS HOLDING SA	ES0109067019	349.00	63.30		EUR	22 092	0.02
SHELL PLC-NEW	GB00BP6MXD84	289.00	28.56		EUR	8 252	0.01
TELEFONICA	ES0178430E18	3 642.00	3.82		EUR	13 927	0.01
BCO SANTANDER C.HISP	ES0113900J37	9 054.00	3.60		EUR	32 613	0.03
FERROVIAL SE	NL0015001FS8	373.00	29.25		EUR	10 910	0.01
INDITEX	ES0148396007	685.00	35.36		EUR	24 222	0.02
BANCO SABADELL SA	ES0113860A34	12 341.00	1.07		EUR	13 180	0.01
CAIXABANK SA	ES0140609019	5 472.00	3.73		EUR	20 432	0.02
CELLNEX TELECOM SAU	ES0105066007	308.00	35.30		EUR	10 872	0.01
UNICREDITO ITALIANO	IT0005239360	1 458.00	22.57		EUR	32 900	0.03
ENI SPA	IT0003132476	1 456.00	14.28		EUR	20 798	0.02
ENEL	IT0003128367	5 400.00	6.21		EUR	33 534	0.03
FINECOBANK SPA	IT0000072170	1 651.00	12.66		EUR	20 902	0.02
TELE2 AB - B SHS	SE0005190238	639.00	77.34		SEK	4 162	0.00
ESSITY AKTIEBO-B	SE0009922164	403.00	255.70		SEK	8 678	0.01
C.FIN.RICHMONT	CH0210483332	73.00	125.60		CHF	9 571	0.01
DSM-Firmenich AG	CH1216478797	92.00	85.15		EUR	7 834	0.01
KONINKLIJKE AHOLD NV	NL0011794037	429.00	30.18		EUR	12 945	0.01



CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-08-31

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	13.10		EUR	34 964	0.03
KONINKLIJKE PHILIPS	NL0000009538	578.00	20.80		EUR	12 022	0.01
ASML NA	NL0010273215	210.00	607.90		EUR	127 659	0.13
ASR NEDERLAND NV	NL0011872643	245.00	40.37		EUR	9 891	0.01
Prosus NV	NL0013654783	248.00	63.78		EUR	15 817	0.02
Adyen NV	NL0012969182	13.00	772.50		EUR	10 043	0.01
STMicroelectronics	92110000110	294.00	43.67		EUR	12 838	0.01
SAMPO OYJ-A SHS	FI0009003305	218.00	40.53		EUR	8 836	0.01
Neste Oyj	FI0009013296	262.00	33.78		EUR	8 850	0.01
ERST BK DER OEST.SPA	AT0000652011	483.00	32.97		EUR	15 925	0.02
CRH ORD	IE0001827041	524.00	53.12		EUR	27 835	0.03
AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO						4 709 253	4.62
GS EuroZone Eq EIC	LU0191250090	781.12	917.68		EUR	716 819	0.70
ALZ EuroInd EqGwt WT	LU0852482198	319.83	2 191.27		EUR	700 832	0.69
Schrd Euro Eq IZ€	LU2004793787	20 350.91	51.89		EUR	1 056 019	1.04
Amundi Eurl Eq-J2Ec	LU1883305259	517.23	2 074.82		EUR	1 073 149	1.05
iShares SMI Eq CHF	CH0008899764	3 236.00	115.24		CHF	389 282	0.38
iShares FTSE100 EqD	IE0005042456	90 270.00	7.33		GBP	773 152	0.76
AÇÕES EMERGENTES						1 073 894	1.05
AÇÕES EMERGENTES - INV. INDIRETO						1 073 894	1.05
GS EmgMkt Eq I€Ac	LU1357028627	32 873.90	16.17		EUR	531 571	0.52
Wellington EM Eq €SA	LU2058844833	67 080.17	8.08		EUR	542 323	0.53
OBRIGAÇÕES						70 580 469	69.20
OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO						44 840 033	43.96
OBRIGAÇÕES GOVERNOS						14 335 973	14.06
OT 2.875% 07/2026	PTOTETOE0012	236 000.00	100.04%	779	EUR	236 861	0.23
DBR 0.25% 02/27	DE0001102416	2 436 000.00	92.37%	3 304	EUR	2 253 437	2.21
OBL 0% 10/2024	DE0001141802	668 000.00	96.33%		EUR	643 491	0.63
FRTR 0% 03/2025	FR0013415627	850 000.00	95.18%		EUR	809 047	0.79
FRTR 0% 02/2027	FR0014003513	2 770 000.00	90.56%		EUR	2 508 512	2.46
SPGB 0% 01/2027	ES0000012J15	1 153 000.00	89.83%		EUR	1 035 728	1.02
SPGB 0% 01/2026	ES0000012G91	998 000.00	92.58%		EUR	923 918	0.91
BTPS 0% 08/2026	IT0005454241	3 273 000.00	90.36%		EUR	2 957 548	2.90
BTPS 0% 12/2024	IT0005474330	353 000.00	95.51%		EUR	337 140	0.33
NETHER 0.75% 07/27	NL0012171458	555 000.00	92.74%	546	EUR	515 270	0.51
RFGB 0% 09/2026	FI4000511449	280 000.00	91.53%		EUR	256 295	0.25
BGB 1% 06/2026	BE0000337460	1 236 000.00	94.86%	2 398	EUR	1 174 855	1.15
RAGB 0.75% 10/26	AT0000A1K9C8	497 000.00	93.73%	3 227	EUR	469 050	0.46
IRISH 1% 05/2026	IE00BV8C9418	225 000.00	95.18%	670	EUR	214 821	0.21
OBRIGAÇÕES CRÉDITO						30 504 060	29.91

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-08-31

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	94.43%	6 274	EUR	478 409	0.47
BCPPL 1.125% 02/2027	PTBCPHOM0066	600 000.00	88.94%	3 717	EUR	537 363	0.53
FIDELI 4.25% 09/2031	PTFIDBOM0009	500 000.00	86.14%	21 075	EUR	451 785	0.44
CXGD 0.375% 09/2027	PTCGDCOM0037	700 000.00	88.80%	2 481	EUR	624 053	0.61
CRLPL 2.5% 11/2026	PTCCCAOM0000	500 000.00	90.53%	10 274	EUR	462 909	0.45
FLOEPT 4,875% 07/28	PTGGDDOM0008	500 000.00	100.18%	3 996	EUR	504 881	0.50
MRKGR 1.625% 06/2079	XS2011260531	500 000.00	95.49%	5 721	EUR	483 181	0.47
DB 1% 11/2025	DE000DL19VR6	500 000.00	95.44%	3 918	EUR	481 133	0.47
NRPBBGR 0.1% 02/2026	DE000A3H2ZX9	700 000.00	88.75%	405	EUR	621 648	0.61
VW 0.125% 02/2027	XS2374595044	500 000.00	87.00%	344	EUR	435 349	0.43
LEGGR 0.875% 11/2027	DE000A254P51	500 000.00	85.95%	3 320	EUR	433 050	0.42
BAYNGR 4,25% 08/2029	XS2630112014	300 000.00	100.83%	209	EUR	302 711	0.30
ULFP 1% 02/2027	FR0013405032	600 000.00	89.74%	3 058	EUR	541 510	0.53
BPCEGP 0.625% 09/24	FR0013429073		96.36%	2 911	EUR	2 911	0.00
BNP 0.25% 04/2027	FR0014002X43	600 000.00	89.71%	578	EUR	538 814	0.53
BFCM 4,125% 03/2029	FR001400GGZ0	500 000.00	100.49%	9 693	EUR	512 163	0.50
ACAFP 3,875% 04/2031	FR001400HCR4	500 000.00	99.06%	7 094	EUR	502 399	0.49
HSBC 1.5% 12/2024	XS1917601582	500 000.00	99.28%	5 568	EUR	501 953	0.49
LLOYDS 0.375% 01/25	XS2109394077	500 000.00	94.90%	1 110	EUR	475 620	0.47
BPLN 3.25% PERP	XS2193661324	500 000.00	93.36%	3 152	EUR	469 957	0.46
VMUKLN 2.875% 06/25	XS2126084750	500 000.00	97.55%	2 710	EUR	490 465	0.48
NWG 1.375% 03/2027	XS2449911143	500 000.00	90.91%	3 438	EUR	457 978	0.45
CEPSA 1% 02/2025	XS1996435688	500 000.00	95.35%	2 699	EUR	479 449	0.47
BKIASM 1.125% 11/26	ES0213307061	600 000.00	90.41%	5 418	EUR	547 872	0.54
SANSCF 0.375% 01/25	XS2100690036	500 000.00	95.11%	1 166	EUR	476 711	0.47
BKTSM 0.625% 10/2027	ES0213679JR9	600 000.00	87.42%	3 390	EUR	527 916	0.52
CLNXSM 0.75% 11/2026	XS2300292617	500 000.00	89.25%	2 979	EUR	449 204	0.44
UCAJLN 4.5% 06/2025	ES0380907057	500 000.00	99.54%	3 873	EUR	501 583	0.49
SABSM 5.125% 11/2028	XS2553801502	500 000.00	101.61%	20 711	EUR	528 756	0.52
KUTXAB 4% 02/2028	ES0343307023	400 000.00	98.52%	9 293	EUR	403 365	0.40
SEB 4% 11/2026	XS2553798443	500 000.00	99.65%	16 219	EUR	514 444	0.50
SWEDA 4,25% 07/2028	XS2572496623	500 000.00	100.11%	3 019	EUR	503 549	0.49
SWEDA 4,375% 09/2030	XS2676305779	500 000.00	99.90%		EUR	499 515	0.49
ISPIM 1% 07/2024	XS2022425297	500 000.00	97.37%	806	EUR	487 636	0.48
UCGIM 5.85% 11/2027	XS2555420103	500 000.00	103.28%	23 240	EUR	539 635	0.53
EMR 0.375% 05/2024	XS1999902502		97.38%	314	EUR	314	0.00
JEF 1% 07/2024	XS2030530450	500 000.00	96.95%	601	EUR	485 356	0.48
BAC 1.379% 02/2025	XS1560863802	600 000.00	98.76%	4 670	EUR	597 200	0.59
MS 0.406% 10/2027	XS2338643740	600 000.00	88.79%	2 049	EUR	534 783	0.52
DLR 2.5% 01/2026	XS1891174341	500 000.00	94.62%	7 808	EUR	480 903	0.47

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-08-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

Designação	Código	Quantidade/ Montante	Cotação	Juro Corrido	Moeda Cotação	Valor (EUR)	Peso (%)
C 2.125% 09/2026	XS1107727007	500 000.00	94.90%	10 363	EUR	484 863	0.48
JPM 0.389% 02/2028	XS2123320033	500 000.00	88.00%	1 007	EUR	441 027	0.43
MS 4.813% 10/2028	XS2548080832	500 000.00	102.14%	20 505	EUR	531 215	0.52
VFC 4,25% 03/2029	XS2592659671	500 000.00	98.61%	10 335	EUR	503 360	0.49
MCD 4% 03/2030	XS2595418166	400 000.00	101.21%	7 781	EUR	412 605	0.40
BAC 4,134% 06/2028	XS2634687912	500 000.00	99.93%	4 575	EUR	504 245	0.49
NIBCAP 0.875% 07/25	XS2023631489	500 000.00	92.74%	657	EUR	464 347	0.46
REPSM 0.25% 08/2027	XS2035620710	200 000.00	87.79%	41	EUR	175 617	0.17
ANNGR 1.5% 06/2026	DE000A182VT2	500 000.00	92.63%	1 701	EUR	464 866	0.46
INTNED 1.25% 02/27	XS2443920249	500 000.00	92.64%	3 373	EUR	466 558	0.46
VW 4.25% 02/2028	XS2554488978	500 000.00	99.85%	11 527	EUR	510 757	0.50
INTNED 4.875% 11/27	XS2554746185	500 000.00	101.57%	19 433	EUR	527 278	0.52
SIENFI 4,25% 04/2029	XS2601459162	300 000.00	96.34%	5 191	EUR	294 196	0.29
RABOBK 4,233% 04/29	XS2613658041	500 000.00	99.52%	7 460	EUR	505 050	0.50
NYKRE 0.75% 01/2027	DK0009526998	500 000.00	88.70%	2 301	EUR	445 781	0.44
CARLB 0.375% 06/2027	XS2191509038	400 000.00	88.03%	258	EUR	352 386	0.35
SYDBDC 4.75% 09/2025	XS2538445581	500 000.00	99.29%	21 863	EUR	518 308	0.51
SPOLNO 0.25% 09/2024	XS2057872595	400 000.00	95.61%	1 151	EUR	383 583	0.38
NESVFH 0.75% 03/2028	FI4000496286	500 000.00	87.21%	1 639	EUR	437 689	0.43
RBIHV 0.25% 01/2025	XS2106056653	600 000.00	93.83%	912	EUR	563 874	0.55
TRAGR 4.125% 11/2025	DE000A3LBGG1	500 000.00	99.33%	15 991	EUR	512 656	0.50
SUMIBK 1.413 06/27	XS1621087516	600 000.00	91.26%	1 830	EUR	549 384	0.54
TACHEM 2.25% 11/2026	XS1843449122	500 000.00	95.18%	8 753	EUR	484 658	0.48
MUFG 0.339% 07/2024	XS2028899727		96.79%	41	EUR	41	0.00
ANZ 1.125% 11/21/29	XS2082818951	500 000.00	94.72%	4 377	EUR	477 977	0.47
ALVGR Var 4.75%10/23	DE000A1YCQ29	600 000.00	99.82%	24 362	EUR	623 306	0.61
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO						25 740 436	25.24
OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO - GOVERNOS						25 740 436	25.24
JPM Eur Gvt Bd I	LU0355584201	7 678.13	110.79		EUR	850 621	0.83
BlueBay Eur GvtBd Q	LU1170327958	12 869.01	99.15		EUR	1 275 963	1.25
iShares Eur GvtBd I	IE00B4WXJJ64	129 681.00	107.73		EUR	13 970 534	13.70
Xtrack US TSY €Hd	LU1399300455	102 486.00	94.09		EUR	9 643 318	9.45
ALTERNATIVOS						905 135	0.89
CAIXA PRIVATE EQUITY	PTYME4LE0005	40 509.00	6.36		EUR	257 459	0.25
CAIXA INFRAESTRUTURA	PTYME7LE0002	82 413.00	7.86		EUR	647 676	0.64
IMOBILIÁRIO						17 047 404	16.71
IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO						4 966 000	4.87
REPUBLICA 35- R/C	P50040000002	8.00			EUR	4 966 000	4.87
IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO						12 081 404	11.84
CXG IMOBILIARIO	PTYMESHE0009	710 909.00	4.15		EUR	2 951 410	2.89

CGD PENSÕES - SGFP,SA
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO
Composição da Carteira em: 2023-08-31

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	8.39		EUR	9 129 994	8.95
LIQUIDEZ						2 700 883	2.65
TOTAL						101 995 837	100.00

Saldos de Unidades de Participação

	Peso (%)	Valor (EUR)
Valor (EUR)	100.00	101 995 837.500000
Quantidade		7 708 483.084259
Cotação 2023-09-01 (EUR)		13.231600

Câmbios

CHF / EUR	1.043885
DKK / EUR	0.134171
EUR / EUR	1.000000
GBP / EUR	1.168470
NOK / EUR	0.086473
SEK / EUR	0.084210
USD / EUR	0.922594