

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa  
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO  
Composição da Carteira em: 2023-12-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

| Designação                    | Código       | Quantidade/<br>Montante | Cotação  | Juro Corrido | Moeda<br>Cotação | Valor<br>(EUR) | Peso<br>(%) |
|-------------------------------|--------------|-------------------------|----------|--------------|------------------|----------------|-------------|
| AÇÕES                         |              |                         |          |              |                  | 10 364 845     | 10.26       |
| AÇÕES EUA                     |              |                         |          |              |                  | 2 176 362      | 2.15        |
| AÇÕES EUA - INV. DIRETO       |              |                         |          |              |                  | 56 794         | 0.06        |
| ESH4 S&P500 03/24             | 91004070059  | 3.00                    | 4 799.25 |              | USD              | 0              | 0.00        |
| CRH PLC                       | IE0001827041 | 386.00                  | 54.10    |              | GBP              | 24 054         | 0.02        |
| STELLANTIS NV                 | NL00150001Q9 | 1 548.00                | 21.15    |              | EUR              | 32 740         | 0.03        |
| AÇÕES EUA - INV. INDIRETO     |              |                         |          |              |                  | 2 119 568      | 2.10        |
| TRowe US BlueCp €l            | LU1136108674 | 21 794.46               | 32.93    |              | EUR              | 717 692        | 0.71        |
| MorganS US Advt Z\$           | LU0360484686 | 3 227.48                | 119.36   |              | USD              | 348 248        | 0.34        |
| JPMorgan-Us S Eq EUR          | LU0973529505 | 2 478.13                | 214.51   |              | EUR              | 531 583        | 0.53        |
| iShares SP500 Value           | US4642874089 | 3 325.00                | 173.68   |              | USD              | 522 045        | 0.52        |
| AÇÕES ÁSIA                    |              |                         |          |              |                  | 1 006 163      | 1.00        |
| AÇÕES ÁSIA - INV. INDIRETO    |              |                         |          |              |                  | 1 006 163      | 1.00        |
| Amun Msci Jp-Acc €            | 92318000042  | 67 623.00               | 14.88    |              | EUR              | 1 006 163      | 1.00        |
| AÇÕES EUROPEIAS               |              |                         |          |              |                  | 6 102 308      | 6.04        |
| AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO |              |                         |          |              |                  | 1 507 800      | 1.49        |
| EDP Renováveis                | ES0127797019 | 679.00                  | 18.53    |              | EUR              | 12 578         | 0.01        |
| VGH4 EUR EUX 03/24            | DE000C6SLNY5 | 11.00                   | 4 548.00 |              | EUR              | 0              | 0.00        |
| BMW                           | DE0005190003 | 128.00                  | 100.78   |              | EUR              | 12 900         | 0.01        |
| COMMERZBANK                   | DE000CBK1001 | 938.00                  | 10.76    |              | EUR              | 10 093         | 0.01        |
| SIEMENS                       | DE0007236101 | 359.00                  | 169.92   |              | EUR              | 61 001         | 0.06        |
| ALLIANZ                       | DE0008404005 | 100.00                  | 241.95   |              | EUR              | 24 195         | 0.02        |
| BASF                          | DE000BASF111 | 215.00                  | 48.78    |              | EUR              | 10 488         | 0.01        |
| BAYER AG                      | DE000BAY0017 | 420.00                  | 33.63    |              | EUR              | 14 125         | 0.01        |
| RWE-RHEINISCH WEST..          | DE0007037129 | 256.00                  | 41.18    |              | EUR              | 10 542         | 0.01        |
| ADIDAS- SALOMON AG            | DE000A1EWWW0 | 110.00                  | 184.16   |              | EUR              | 20 258         | 0.02        |
| MERCK KGAA                    | DE0006599905 | 82.00                   | 144.10   |              | EUR              | 11 816         | 0.01        |
| SAP SE                        | DE0007164600 | 299.00                  | 139.48   |              | EUR              | 41 705         | 0.04        |
| DEUTSCHE TELEKOM              | DE0005557508 | 1 566.00                | 21.75    |              | EUR              | 34 061         | 0.03        |
| HEIDELBERGER ZEMENT           | DE0006047004 | 97.00                   | 80.94    |              | EUR              | 7 851          | 0.01        |
| Mercedes-Benz Grp AG          | DE0007100000 | 356.00                  | 62.55    |              | EUR              | 22 268         | 0.02        |
| INFINEON TECHNOLOGIE          | DE0006231004 | 479.00                  | 37.80    |              | EUR              | 18 106         | 0.02        |
| DEUTSCHE POST                 | DE0005552004 | 465.00                  | 44.86    |              | EUR              | 20 858         | 0.02        |
| DEUTSCHE BOERSE AG            | DE0005810055 | 61.00                   | 186.50   |              | EUR              | 11 377         | 0.01        |
| VONOVIA SE                    | DE000A1ML7J1 | 574.00                  | 28.54    |              | EUR              | 16 382         | 0.02        |
| DANONE                        | FR0000120644 | 167.00                  | 58.68    |              | EUR              | 9 800          | 0.01        |
| AXA-UAP                       | FR0000120628 | 1 001.00                | 29.49    |              | EUR              | 29 519         | 0.03        |
| CARREFOUR                     | FR0000120172 | 493.00                  | 16.57    |              | EUR              | 8 167          | 0.01        |

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa  
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO  
Composição da Carteira em: 2023-12-31

## COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO

| Designação           | Código       | Quantidade/<br>Montante | Cotação  | Juro Corrido | Moeda<br>Cotação | Valor<br>(EUR) | Peso<br>(%) |
|----------------------|--------------|-------------------------|----------|--------------|------------------|----------------|-------------|
| PERNOD RICARD        | FR0000120693 | 114.00                  | 159.75   |              | EUR              | 18 212         | 0.02        |
| TotalEnergies SE     | FR0000120271 | 825.00                  | 61.60    |              | EUR              | 50 820         | 0.05        |
| L OREAL              | FR0000120321 | 95.00                   | 450.65   |              | EUR              | 42 812         | 0.04        |
| Kering               | FR0000121485 | 16.00                   | 399.00   |              | EUR              | 6 384          | 0.01        |
| BNP                  | FR0000131104 | 246.00                  | 62.59    |              | EUR              | 15 397         | 0.02        |
| AIR LIQUIDE          | FR0000120073 | 264.00                  | 176.12   |              | EUR              | 46 496         | 0.05        |
| SCHNEIDER            | FR0000121972 | 157.00                  | 181.78   |              | EUR              | 28 539         | 0.03        |
| L.V.M.H.             | FR0000121014 | 112.00                  | 733.60   |              | EUR              | 82 163         | 0.08        |
| MICHELIN             | FR001400AJ45 | 444.00                  | 32.46    |              | EUR              | 14 412         | 0.01        |
| SAINT-GOBAIN         | FR0000125007 | 379.00                  | 66.66    |              | EUR              | 25 264         | 0.03        |
| THOMSON              | FR0000121329 | 83.00                   | 133.95   |              | EUR              | 11 118         | 0.01        |
| SOCIETE GENERALE     | FR0000130809 | 655.00                  | 24.03    |              | EUR              | 15 736         | 0.02        |
| CAP GEMINI SOGETI    | FR0000125338 | 128.00                  | 188.75   |              | EUR              | 24 160         | 0.02        |
| EssilorLuxottica     | FR0000121667 | 102.00                  | 181.60   |              | EUR              | 18 523         | 0.02        |
| GLE ENTREP. VINCI    | FR0000125486 | 218.00                  | 113.70   |              | EUR              | 24 787         | 0.02        |
| SANOFI SYNHLABO      | FR0000120578 | 436.00                  | 89.76    |              | EUR              | 39 135         | 0.04        |
| VEOLIA ENVIRONEMENT  | FR0000124141 | 340.00                  | 28.56    |              | EUR              | 9 710          | 0.01        |
| AIRBUS SE            | NL0000235190 | 293.00                  | 139.78   |              | EUR              | 40 956         | 0.04        |
| SAFRAN SA            | FR0000073272 | 64.00                   | 159.46   |              | EUR              | 10 205         | 0.01        |
| HERMES INTERNACIONAL | FR0000052292 | 16.00                   | 1 918.80 |              | EUR              | 30 701         | 0.03        |
| TELEPERFORMANCE      | FR0000051807 | 40.00                   | 132.05   |              | EUR              | 5 282          | 0.01        |
| RECKITT BENCKISER    | GB00B24CGK77 | 132.00                  | 54.20    |              | GBP              | 8 241          | 0.01        |
| OCADO GROUP PLC      | GB00B3MBS747 | 836.00                  | 7.58     |              | GBP              | 7 303          | 0.01        |
| ASHTREAD GROUP PLC   | GB0000536739 | 119.00                  | 54.62    |              | GBP              | 7 487          | 0.01        |
| AMADEUS HOLDING SA   | ES0109067019 | 297.00                  | 64.88    |              | EUR              | 19 269         | 0.02        |
| SHELL PLC-NEW        | GB00BP6MXD84 | 246.00                  | 29.80    |              | EUR              | 7 331          | 0.01        |
| BCO SANTANDER C.HISP | ES0113900J37 | 7 704.00                | 3.78     |              | EUR              | 29 117         | 0.03        |
| FERROVIAL SE         | NL0015001FS8 | 317.00                  | 33.02    |              | EUR              | 10 467         | 0.01        |
| INDITEX              | ES0148396007 | 583.00                  | 39.43    |              | EUR              | 22 988         | 0.02        |
| BANCO SABADELL SA    | ES0113860A34 | 10 500.00               | 1.11     |              | EUR              | 11 687         | 0.01        |
| CAIXABANK SA         | ES0140609019 | 4 656.00                | 3.73     |              | EUR              | 17 348         | 0.02        |
| CELLNEX TELECOM SAU  | ES0105066007 | 417.00                  | 35.66    |              | EUR              | 14 870         | 0.01        |
| UNICREDITO ITALIANO  | IT0005239360 | 1 241.00                | 24.57    |              | EUR              | 30 485         | 0.03        |
| ENI SPA              | IT0003132476 | 1 239.00                | 15.35    |              | EUR              | 19 016         | 0.02        |
| ENEL                 | IT0003128367 | 4 595.00                | 6.73     |              | EUR              | 30 924         | 0.03        |
| FINECOBANK SPA       | IT0000072170 | 1 405.00                | 13.59    |              | EUR              | 19 087         | 0.02        |
| ESSITY AKTIEBO-B     | SE0009922164 | 343.00                  | 249.90   |              | SEK              | 7 709          | 0.01        |
| C.FIN.RICHMONT       | CH0210483332 | 62.00                   | 115.75   |              | CHF              | 7 717          | 0.01        |
| DSM-Firmenich AG     | CH1216478797 | 173.00                  | 92.00    |              | EUR              | 15 916         | 0.02        |
| KONINKLIJKE AHOLD NV | NL0011794037 | 365.00                  | 26.02    |              | EUR              | 9 495          | 0.01        |

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa  
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO  
Composição da Carteira em: 2023-12-31

## COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

AÇÕES > AÇÕES EUROPEIAS > AÇÕES EUROPEIAS - INV. DIRETO

| Designação                       | Código       | Quantidade/<br>Montante | Cotação  | Juro Corrido | Moeda<br>Cotação | Valor<br>(EUR) | Peso<br>(%) |
|----------------------------------|--------------|-------------------------|----------|--------------|------------------|----------------|-------------|
| ING GROEP NV                     | NL0011821202 | 2 271.00                | 13.53    |              | EUR              | 30 718         | 0.03        |
| ASML NA                          | NL0010273215 | 179.00                  | 681.70   |              | EUR              | 122 024        | 0.12        |
| ASR NEDERLAND NV                 | NL0011872643 | 208.00                  | 42.70    |              | EUR              | 8 882          | 0.01        |
| Prosus NV                        | NL0013654783 | 459.00                  | 26.99    |              | EUR              | 12 386         | 0.01        |
| Adyen NV                         | NL0012969182 | 11.00                   | 1 166.60 |              | EUR              | 12 833         | 0.01        |
| Universal Music Grp              | NL0015000IY2 | 568.00                  | 25.81    |              | EUR              | 14 660         | 0.01        |
| STMICROELECTRONICS               | 92110000110  | 250.00                  | 45.25    |              | EUR              | 11 311         | 0.01        |
| SAMPO OYJ-A SHS                  | FI4000552500 | 185.00                  | 39.58    |              | EUR              | 7 322          | 0.01        |
| Neste Oyj                        | FI0009013296 | 223.00                  | 32.33    |              | EUR              | 7 210          | 0.01        |
| ERST BK DER OEST.SPA             | AT0000652011 | 411.00                  | 36.73    |              | EUR              | 15 096         | 0.01        |
| AÇÕES EUROPEIAS - INV. INDIRETO  |              |                         |          |              |                  | 4 594 508      | 4.55        |
| Schrd Euro Eq IZ€                | LU2004793787 | 13 396.83               | 52.27    |              | EUR              | 700 300        | 0.69        |
| Amundi Eurl Eq-J2Ec              | LU1883305259 | 646.41                  | 2 185.86 |              | EUR              | 1 412 971      | 1.40        |
| Goldman Sachs-Q Eur              | LU2639511745 | 141.27                  | 5 326.45 |              | EUR              | 752 452        | 0.75        |
| iShares SMI Eq CHF               | CH0008899764 | 3 236.00                | 115.52   |              | CHF              | 401 999        | 0.40        |
| iShares FTSE100 EqD              | IE0005042456 | 90 270.00               | 7.53     |              | GBP              | 783 071        | 0.78        |
| Ishares € Mkt Grw                | IE00B0M62V02 | 6 740.00                | 54.22    |              | EUR              | 365 443        | 0.36        |
| Lyxor Msciemu Grwt               | LU1598688189 | 1 030.00                | 173.08   |              | EUR              | 178 272        | 0.18        |
| AÇÕES EMERGENTES                 |              |                         |          |              |                  | 1 080 012      | 1.07        |
| AÇÕES EMERGENTES - INV. INDIRETO |              |                         |          |              |                  | 1 080 012      | 1.07        |
| GS EmgMkt Eq I€Ac                | LU1357028627 | 32 873.90               | 16.32    |              | EUR              | 536 502        | 0.53        |
| Wellington EM Eq €SA             | LU2058844833 | 67 080.17               | 8.10     |              | EUR              | 543 510        | 0.54        |
| OBRIGAÇÕES                       |              |                         |          |              |                  | 70 616 196     | 69.92       |
| OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO         |              |                         |          |              |                  | 45 252 150     | 44.81       |
| OBRIGAÇÕES GOVERNOS              |              |                         |          |              |                  | 14 213 119     | 14.07       |
| OT 2.875% 07/2026                | PTOTETOE0012 | 347 000.00              | 101.73%  | 4 470        | EUR              | 357 463        | 0.35        |
| DBR 0.25% 02/27                  | DE0001102416 | 2 565 000.00            | 94.67%   | 5 622        | EUR              | 2 433 933      | 2.41        |
| DBR 0.25% 08/2028                | DE0001102457 | 248 000.00              | 92.80%   | 235          | EUR              | 230 384        | 0.23        |
| OBL 0% 10/2024                   | DE0001141802 | 211 000.00              | 97.50%   |              | EUR              | 205 723        | 0.20        |
| FRTR 0% 03/2025                  | FR0013415627 | 454 000.00              | 96.53%   |              | EUR              | 438 233        | 0.43        |
| FRTR 0% 02/2027                  | FR0014003513 | 3 127 000.00            | 93.15%   |              | EUR              | 2 912 644      | 2.88        |
| SPGB 1.4% 07/28                  | ES0000012B88 | 705 000.00              | 95.08%   | 4 180        | EUR              | 674 515        | 0.67        |
| SPGB 0% 01/2026                  | ES0000012G91 | 1 412 000.00            | 94.64%   |              | EUR              | 1 336 260      | 1.32        |
| BTPS 0% 08/2026                  | IT0005454241 | 3 354 000.00            | 93.17%   |              | EUR              | 3 124 855      | 3.09        |
| BTPS 0,5% 07/2028                | IT0005445306 | 86 000.00               | 89.82%   | 199          | EUR              | 77 446         | 0.08        |
| NETHER 0.75% 07/27               | NL0012171458 | 501 000.00              | 95.29%   | 1 745        | EUR              | 479 138        | 0.47        |
| RFGB 0% 09/2026                  | FI4000511449 | 256 000.00              | 93.74%   |              | EUR              | 239 982        | 0.24        |
| BGB 1% 06/2026                   | BE0000337460 | 1 042 000.00            | 96.78%   | 5 495        | EUR              | 1 013 953      | 1.00        |
| RAGB 0.75% 10/26                 | AT0000A1K9C8 | 506 000.00              | 95.64%   | 757          | EUR              | 484 695        | 0.48        |
| IRISH 1% 05/2026                 | IE00BV8C9418 | 209 000.00              | 96.93%   | 1 319        | EUR              | 203 894        | 0.20        |

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa  
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO  
Composição da Carteira em: 2023-12-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

| Designação           | Código       | Quantidade/<br>Montante | Cotação | Juro Corrido | Moeda<br>Cotação | Valor<br>(EUR) | Peso<br>(%) |
|----------------------|--------------|-------------------------|---------|--------------|------------------|----------------|-------------|
| OBRIGAÇÕES CRÉDITO   |              |                         |         |              |                  | 31 039 031     | 30.73       |
| GALPPL 2% 01/2026    | PTGALCOM0013 | 500 000.00              | 96.46%  | 9 616        | EUR              | 491 936        | 0.49        |
| BCPPL 1.125% 02/2027 | PTBCPHOM0066 | 300 000.00              | 94.37%  | 2 987        | EUR              | 286 082        | 0.28        |
| FIDELI 4.25% 09/2031 | PTFIDBOM0009 | 500 000.00              | 88.65%  | 6 909        | EUR              | 450 159        | 0.45        |
| CXGD 0.375% 09/2027  | PTCGDCOM0037 | 500 000.00              | 92.39%  | 523          | EUR              | 462 493        | 0.46        |
| CRLPL 2.5% 11/2026   | PTCCCAOM0000 | 500 000.00              | 93.01%  | 1 947        | EUR              | 466 987        | 0.46        |
| FLOEPT 4,875% 07/28  | PTGGDDOM0008 | 500 000.00              | 103.63% | 12 121       | EUR              | 530 256        | 0.53        |
| MRKGR 1.625% 06/2079 | XS2011260531 | 500 000.00              | 97.16%  | 311          | EUR              | 486 131        | 0.48        |
| DB 1% 11/2025        | DE000DL19VR6 | 500 000.00              | 97.19%  | 587          | EUR              | 486 537        | 0.48        |
| VW 0.125% 02/2027    | XS2374595044 | 500 000.00              | 90.71%  | 553          | EUR              | 454 098        | 0.45        |
| LEGGR 0.875% 11/2027 | DE000A254P51 | 500 000.00              | 90.32%  | 406          | EUR              | 452 021        | 0.45        |
| BAYNGR 4,25% 08/2029 | XS2630112014 | 300 000.00              | 103.44% | 4 459        | EUR              | 314 770        | 0.31        |
| ULFP 1% 02/2027      | FR0013405032 | 600 000.00              | 93.24%  | 5 063        | EUR              | 564 527        | 0.56        |
| BNP 0.25% 04/2027    | FR0014002X43 | 400 000.00              | 92.70%  | 719          | EUR              | 371 511        | 0.37        |
| CAFP 4,125% 10/2028  | FR001400D0F9 | 500 000.00              | 103.83% | 4 565        | EUR              | 523 730        | 0.52        |
| BFCM 4,125% 03/2029  | FR001400GGZ0 | 300 000.00              | 103.64% | 9 941        | EUR              | 320 855        | 0.32        |
| ACAFP 3,875% 04/2031 | FR001400HCR4 | 500 000.00              | 103.12% | 13 552       | EUR              | 529 157        | 0.52        |
| ENGIFP 3,875% 01/31  | FR001400KHG0 | 500 000.00              | 103.31% | 6 211        | EUR              | 522 761        | 0.52        |
| AKEFP 4,25% 05/2030  | FR001400M2R9 | 500 000.00              | 104.29% | 2 445        | EUR              | 523 905        | 0.52        |
| RENAUL 4,875% 10/29  | FR001400KY69 | 500 000.00              | 105.11% | 6 060        | EUR              | 531 605        | 0.53        |
| LLOYDS 0.375% 01/25  | XS2109394077 | 300 000.00              | 96.52%  | 1 042        | EUR              | 290 611        | 0.29        |
| BPLN 3.25% PERP      | XS2193661324 | 500 000.00              | 96.46%  | 8 569        | EUR              | 490 844        | 0.49        |
| VMUKLN 2.875% 06/25  | XS2126084750 | 500 000.00              | 99.25%  | 314          | EUR              | 496 544        | 0.49        |
| NWG 1.375% 03/2027   | XS2449911143 | 500 000.00              | 94.06%  | 5 729        | EUR              | 476 049        | 0.47        |
| CEPSA 1% 02/2025     | XS1996435688 | 500 000.00              | 97.06%  | 4 370        | EUR              | 489 670        | 0.48        |
| BKIASM 1.125% 11/26  | ES0213307061 | 400 000.00              | 93.70%  | 615          | EUR              | 375 395        | 0.37        |
| BKTSM 0.625% 10/2027 | ES0213679JR9 | 300 000.00              | 90.88%  | 446          | EUR              | 273 086        | 0.27        |
| CLNXSM 0.75% 11/2026 | XS2300292617 | 500 000.00              | 92.37%  | 482          | EUR              | 462 337        | 0.46        |
| UCAJLN 4.5% 06/2025  | ES0380907057 | 500 000.00              | 99.97%  | 11 373       | EUR              | 511 218        | 0.51        |
| SABSM 5.125% 11/2028 | XS2553801502 | 500 000.00              | 105.05% | 3 641        | EUR              | 528 891        | 0.52        |
| KUTXAB 4% 02/2028    | ES0343307023 | 400 000.00              | 101.06% | 14 641       | EUR              | 418 889        | 0.41        |
| ABANCA 5,875% 04/30  | ES0265936056 | 500 000.00              | 106.22% | 7 324        | EUR              | 538 429        | 0.53        |
| EDPPL 4,125% 04/2029 | XS2699159278 | 500 000.00              | 104.02% | 5 029        | EUR              | 525 139        | 0.52        |
| ABESM 2,25% 03/2029  | XS2195092601 | 500 000.00              | 93.85%  | 8 545        | EUR              | 477 805        | 0.47        |
| SWEDA 4,375% 09/2030 | XS2676305779 | 500 000.00              | 103.50% | 7 053        | EUR              | 524 548        | 0.52        |
| UCGIM 5.85% 11/2027  | XS2555420103 | 300 000.00              | 105.81% | 2 254        | EUR              | 319 672        | 0.32        |
| JEF 1% 07/2024       | XS2030530450 | 500 000.00              | 98.26%  | 2 268        | EUR              | 493 553        | 0.49        |
| BAC 1.379% 02/2025   | XS1560863802 | 300 000.00              | 99.75%  | 3 718        | EUR              | 302 974        | 0.30        |
| MS 0.406% 10/2027    | XS2338643740 | 400 000.00              | 91.79%  | 284          | EUR              | 367 436        | 0.36        |
| DLR 2.5% 01/2026     | XS1891174341 | 500 000.00              | 97.25%  | 11 986       | EUR              | 498 221        | 0.49        |



# CGD Pensões

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa  
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO  
Composição da Carteira em: 2023-12-31

## COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

OBRIGAÇÕES > OBRIGAÇÕES - INV. DIRETO > OBRIGAÇÕES CRÉDITO

| Designação                            | Código       | Quantidade/<br>Montante | Cotação | Juro Corrido | Moeda<br>Cotação | Valor<br>(EUR) | Peso<br>(%) |
|---------------------------------------|--------------|-------------------------|---------|--------------|------------------|----------------|-------------|
| JPM 0.389% 02/2028                    | XS2123320033 | 500 000.00              | 91.02%  | 1 657        | EUR              | 456 742        | 0.45        |
| MS 4.813% 10/2028                     | XS2548080832 | 500 000.00              | 104.60% | 4 471        | EUR              | 527 486        | 0.52        |
| VFC 4,25% 03/2029                     | XS2592659671 | 500 000.00              | 95.75%  | 17 418       | EUR              | 496 163        | 0.49        |
| MCD 4% 03/2030                        | XS2595418166 | 400 000.00              | 104.63% | 13 115       | EUR              | 431 651        | 0.43        |
| BAC 4,134% 06/2028                    | XS2634687912 | 300 000.00              | 103.06% | 6 879        | EUR              | 316 059        | 0.31        |
| GE 1,5% 05/2029                       | XS1612543121 | 500 000.00              | 92.36%  | 4 693        | EUR              | 466 488        | 0.46        |
| T 2,6% 12/2029                        | XS1144088165 | 500 000.00              | 96.20%  | 533          | EUR              | 481 523        | 0.48        |
| FIS 1% 12/2028                        | XS2085655590 | 500 000.00              | 90.14%  | 396          | EUR              | 451 071        | 0.45        |
| NIBCAP 0.875% 07/25                   | XS2023631489 | 500 000.00              | 95.53%  | 2 116        | EUR              | 479 741        | 0.48        |
| REPSM 0.25% 08/2027                   | XS2035620710 | 200 000.00              | 90.50%  | 208          | EUR              | 181 216        | 0.18        |
| ANNGR 1.5% 06/2026                    | DE000A182VT2 | 500 000.00              | 95.24%  | 4 201        | EUR              | 480 376        | 0.48        |
| INTNED 1.25% 02/27                    | XS2443920249 | 500 000.00              | 95.02%  | 5 462        | EUR              | 480 582        | 0.48        |
| VW 4.25% 02/2028                      | XS2554488978 | 500 000.00              | 103.19% | 18 630       | EUR              | 534 580        | 0.53        |
| INTNED 4.875% 11/27                   | XS2554746185 | 500 000.00              | 103.65% | 3 197        | EUR              | 521 462        | 0.52        |
| RABOBK 4,233% 04/29                   | XS2613658041 | 500 000.00              | 102.83% | 14 515       | EUR              | 528 670        | 0.52        |
| SIEGR 1,375% 09/2030                  | XS1874127902 | 500 000.00              | 91.59%  | 2 198        | EUR              | 460 138        | 0.46        |
| SDZSW 4,22% 04/2030                   | XS2715940891 | 500 000.00              | 103.54% | 2 601        | EUR              | 520 321        | 0.52        |
| NYKRE 0.75% 01/2027                   | DK0009526998 | 500 000.00              | 91.94%  | 3 555        | EUR              | 463 275        | 0.46        |
| CARLB 0.375% 06/2027                  | XS2191509038 | 400 000.00              | 91.02%  | 758          | EUR              | 364 854        | 0.36        |
| SYDBDC 4.75% 09/2025                  | XS2538445581 | 500 000.00              | 100.28% | 6 035        | EUR              | 507 415        | 0.50        |
| NYKRE 4,625% 01/2029                  | DK0030512421 | 500 000.00              | 103.26% | 2 598        | EUR              | 518 883        | 0.51        |
| DNBNO 4,625% 11/2029                  | XS2698148702 | 500 000.00              | 105.00% | 3 854        | EUR              | 528 854        | 0.52        |
| NESVFH 0.75% 03/2028                  | FI4000496286 | 500 000.00              | 90.65%  | 2 889        | EUR              | 456 139        | 0.45        |
| RBIAB 0.25% 01/2025                   | XS2106056653 | 300 000.00              | 96.05%  | 707          | EUR              | 288 851        | 0.29        |
| TRAGR 4.125% 11/2025                  | DE000A3LBGG1 | 500 000.00              | 100.67% | 2 254        | EUR              | 505 599        | 0.50        |
| BDX 3,553% 09/2029                    | XS2585932275 | 500 000.00              | 101.95% | 5 339        | EUR              | 515 069        | 0.51        |
| SUMIBK 1.413 06/27                    | XS1621087516 | 500 000.00              | 93.78%  | 3 880        | EUR              | 472 800        | 0.47        |
| TACHEM 2.25% 11/2026                  | XS1843449122 | 500 000.00              | 97.51%  | 1 260        | EUR              | 488 815        | 0.48        |
| ANZ 1.125% 11/21/29                   | XS2082818951 | 500 000.00              | 96.55%  | 630          | EUR              | 483 380        | 0.48        |
| OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO            |              |                         |         |              |                  | 25 364 046     | 25.11       |
| OBRIGAÇÕES - INV. INDIRETO - GOVERNOS |              |                         |         |              |                  | 25 364 046     | 25.11       |
| JPM Eur Gvt Bd I                      | LU0355584201 | 7 678.13                | 116.82  |              | EUR              | 896 982        | 0.89        |
| BlueBay Eur GvtBd Q                   | LU1170327958 | 11 808.84               | 104.31  |              | EUR              | 1 231 780      | 1.22        |
| iShares Eur GvtBd I                   | IE00B4WXJJ64 | 121 804.00              | 112.72  |              | EUR              | 13 729 138     | 13.59       |
| Xtrack US TSY €Hd                     | LU1399300455 | 99 366.00               | 95.67   |              | EUR              | 9 506 146      | 9.41        |
| ALTERNATIVOS                          |              |                         |         |              |                  | 922 277        | 0.91        |
| CAIXA PRIVATE EQUITY                  | PTyme4LE0005 | 40 509.00               | 6.54    |              | EUR              | 265 107        | 0.26        |
| CAIXA INFRAESTRUTURA                  | PTyme7LE0002 | 82 413.00               | 7.97    |              | EUR              | 657 170        | 0.65        |
| IMOBILIÁRIO                           |              |                         |         |              |                  | 17 653 005     | 17.48       |
| IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO             |              |                         |         |              |                  | 5 563 000      | 5.51        |

CGD PENSÕES - SGFP,SA  
Av. Joao XXI, 63, 1000-300, Lisboa  
FUNDO: CAIXA REFORMA DEFENSIVO  
Composição da Carteira em: 2023-12-31

COMPOSIÇÃO DETALHADA DA CARTEIRA

IMOBILIÁRIO > IMOBILIÁRIO - INV. DIRETO

| Designação                  | Código       | Quantidade/<br>Montante | Cotação | Juro Corrido | Moeda<br>Cotação | Valor<br>(EUR) | Peso<br>(%) |
|-----------------------------|--------------|-------------------------|---------|--------------|------------------|----------------|-------------|
| REPUBLICA 35- R/C           | P50040000002 | 8.00                    |         |              | EUR              | 5 563 000      | 5.51        |
| IMOBILIÁRIO - INV. INDIRETO |              |                         |         |              |                  | 12 090 005     | 11.97       |
| CXG IMOBILIARIO             | PTYMESHE0009 | 710 909.00              | 4.09    |              | EUR              | 2 907 547      | 2.88        |
| Fundimo                     | PTYCXTHM0007 | 1 088 472.00            | 8.44    |              | EUR              | 9 182 459      | 9.09        |
| LIQUIDEZ                    |              |                         |         |              |                  | 1 436 360      | 1.42        |
| TOTAL                       |              |                         |         |              |                  | 100 992 683    | 100.00      |

Saldos de Unidades de Participação

|                          | Peso<br>(%) | Valor<br>(EUR)     |
|--------------------------|-------------|--------------------|
| Valor (EUR)              | 100.00      | 100 992 683.090000 |
| Quantidade               |             | 7 383 257.279949   |
| Cotação 2024-01-01 (EUR) |             | 13.678600          |

Câmbios

|           |          |
|-----------|----------|
| CHF / EUR | 1.075373 |
| DKK / EUR | 0.134147 |
| EUR / EUR | 1.000000 |
| GBP / EUR | 1.151875 |
| NOK / EUR | 0.089274 |
| SEK / EUR | 0.089931 |
| USD / EUR | 0.903996 |