

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
 Composição da Carteira em 2018-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
COMPOSIÇÃO DISCRIMINADA CARTEIRA						
VALORES MOBILIÁRIOS COTADOS						
Merc. Cot. Oficiais de Bolsa Val. Port.					155 718	9 446 315
Títulos de Dívida Pública						
OT 4.8% 06/2020	1 250 000	111.57%	EUR	111.57%	37 973	1 432 573
OT 3.85% 04/2021	1 750 000	111.81%	EUR	111.81%	53 900	2 010 540
OT 4.75% 06/2019	2 000 000	106.84%	EUR	106.84%	60 384	2 197 124
						5 640 236
Obrigações diversas						
CXGD 3% 01/2019	600 000	102.99%	EUR	102.99%	838	618 802
VERSE 2 SNR 02/2018	107 979	100.13%	EUR	100.13%	134	108 254
TAGST 09-ENGY A1/25	776 487	102.90%	EUR	102.90%	682	799 687
CXGD 1% 01/2022	700 000	101.60%	EUR	101.60%	96	711 268
VERSE 3 SNR 02/2019	1 161 508	100.86%	EUR	100.86%	1 220	1 172 717
VERSE 4 SNR 02/2021	384 093	102.80%	EUR	102.80%	491	395 350
						3 806 078
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					1 726 528	167 753 628
Títulos de Dívida Pública						
FADE 0.031% 06/2020	5 400 000	100.07%	EUR	100.07%	1 055	5 404 565
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	1 000 000	100.92%	EUR	100.92%	97	1 009 337
VW Float 07/19	1 100 000	100.27%	EUR	100.27%	15	1 102 930
BASGR Float 11/19	1 300 000	100.52%	EUR	100.52%		1 306 695
COFP 4.481% 11/2018	6 000 000	104.36%	EUR	104.36%	76 309	6 338 089
LGFP 5.375% 11/2018	5 000 000	104.45%	EUR	104.45%	47 123	5 269 573
MWDP 6.75% 04/2018	4 000 000	101.44%	EUR	101.44%	212 301	4 270 061
COFP 3.994 03/2020	1 000 000	110.02%	EUR	110.02%	36 001	1 136 221
PPFP 3.125% 04/2019	1 200 000	103.94%	EUR	103.94%	29 178	1 276 398
RENAUL 1.125% 09/19	1 200 000	101.78%	EUR	101.78%	4 586	1 225 994
MCFP 1% 09/2021	1 400 000	102.68%	EUR	102.68%	4 986	1 442 464
BPCEGP 5.1% 06/2018	1 480 000	102.11%	EUR	102.11%	7 548	1 518 769
RENAUL 3.625% 09/18	2 000 000	102.35%	EUR	102.35%	26 815	2 073 855
KERFP 1.875% 10/2018	1 500 000	101.39%	EUR	101.39%	8 938	1 529 713
BPCEGP 3.7% 05/2018	2 530 000	101.10%	EUR	101.10%	20 096	2 577 938
BNFP Float 11/18	400 000	100.18%	EUR	100.18%		400 728
RENAULT Float 08/20	100 000	100.57%	EUR	100.57%	8	100 573
BPCEGP Float 03/22	500 000	103.09%	EUR	103.09%	524	515 984
RENAULT Float 04/21	100 000	100.98%	EUR	100.98%	18	100 994
ACAFP Float 04/22	1 000 000	102.22%	EUR	102.22%	131	1 022 331
MCFP 0% 05/20	4 300 000	99.96%	EUR	99.96%		4 298 108
MCFP Float 11/18	465 000	100.23%	EUR	100.23%		466 083
BNP Float 06/24	800 000	102.41%	EUR	102.41%	528	819 784
RENAUL Float 03/2022	400 000	101.42%	EUR	101.42%	187	405 863
GFCFP Float 06/22	800 000	100.37%	EUR	100.37%	39	803 015
ALDFP Float 11/20	500 000	100.53%	EUR	100.53%	93	502 738

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ABBEY 2.625% 07/2020	750 000	106.13%	EUR	106.13%	10 788	806 778
LLOYDS 1.875% 10/18	1 500 000	101.46%	EUR	101.46%	8 784	1 530 699
ABBEY 2% 01/2019	1 000 000	102.12%	EUR	102.12%	986	1 022 226
DGELN 1.125% 05/2019	1 000 000	101.48%	EUR	101.48%	7 921	1 022 691
F 1.75% 05/18	5 000 000	100.55%	EUR	100.55%	61 370	5 089 070
ABBEY 0.875% 01/2020	500 000	101.71%	EUR	101.71%	228	508 768
LLOYDS 0.625% 04/20	1 500 000	101.33%	EUR	101.33%	7 372	1 527 337
HSBC Float 09/22	750 000	101.54%	EUR	101.54%	278	761 791
F Float 08/20	300 000	100.67%	EUR	100.67%	94	302 107
WPPLN Float 05/20	800 000	100.35%	EUR	100.35%		802 816
SANUK Float 05/23	500 000	101.81%	EUR	101.81%	457	509 512
RBS Float 06/20	900 000	100.62%	EUR	100.62%	143	905 714
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	102.35%	EUR	102.35%	526	1 024 026
HSBC 0.17% 10/23	500 000	100.76%	EUR	100.76%	64	503 859
TELEFO 4.693% 11/19	1 000 000	108.34%	EUR	108.34%	10 543	1 093 893
REDELE 4.875% 04/202	1 000 000	110.83%	EUR	110.83%	37 130	1 145 430
TELEFO 4.797 02/2018	5 000 000	100.25%	EUR	100.25%	226 708	5 239 258
CABKSM 3.125% 05/18	4 000 000	100.88%	EUR	100.88%	90 068	4 125 148
SANTAN 1.1% 07/2018	2 000 000	100.65%	EUR	100.65%	11 271	2 024 211
SANSCF Float 01/19	600 000	100.26%	EUR	100.26%	42	601 626
IBESM Float 02/24	1 100 000	101.02%	EUR	101.02%	761	1 111 959
SANTAN Float 03/22	600 000	102.56%	EUR	102.56%	484	615 850
BBVASM Float 04/22	1 200 000	101.35%	EUR	101.35%	181	1 216 417
CRUNAV Float 06/2022	500 000	99.56%	EUR	99.56%	187	497 982
VLVY 2.375% 11/26/19	250 000	104.23%	EUR	104.23%	1 090	261 660
SCANIA Float 10/18	500 000	100.18%	EUR	100.18%	2	500 912
SCANIA Float 04/20	500 000	100.43%	EUR	100.43%	10	502 140
ENIIM 4.25% 02/20	700 000	108.39%	EUR	108.39%	29 587	788 296
ENELIM 4.875% 02/18	2 900 000	100.25%	EUR	100.25%	134 016	3 041 179
ISPIM 1.125% 01/2020	1 600 000	102.10%	EUR	102.10%	888	1 634 520
ISPIM 4.125% 04/2020	750 000	108.88%	EUR	108.88%	24 835	841 457
UCGIM 5% 05/2018	475 000	101.53%	EUR	101.53%	16 658	498 925
UCGIM 5.65% 08/2018	1 000 000	103.20%	EUR	103.20%	24 922	1 056 897
UCGIM 6.1% 03/2018	600 000	100.71%	EUR	100.71%	32 288	636 548
ISPIM Float 04/22	450 000	102.54%	EUR	102.54%	101	461 509
GS 5.125% 10/2019	1 200 000	108.86%	EUR	108.86%	17 018	1 323 290
MS 2.25% 03/2018	2 000 000	100.25%	EUR	100.25%	40 192	2 045 132
BAC 2.5% 07/2020	750 000	106.01%	EUR	106.01%	9 709	804 799
JPM Float 06/2018	650 000	100.13%	EUR	100.13%		650 865
MS Float 01/22	500 000	101.20%	EUR	101.20%	16	506 016
MS Float 03/12/2019	200 000	100.33%	EUR	100.33%	57	200 719
BAC Float 02/22	200 000	101.57%	EUR	101.57%	225	203 367
BAC Float 05/23	400 000	101.85%	EUR	101.85%	436	407 844
GM Float 05/21	1 800 000	101.03%	EUR	101.03%	1 457	1 819 961
T Float 09/2023	1 500 000	102.42%	EUR	102.42%	1 288	1 537 603
TMO Float 07/2019	1 500 000	100.28%	EUR	100.28%		1 504 200
BATSLN Float 08/21	500 000	100.80%	EUR	100.80%	183	504 203

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BAC Float 09/21	500 000	100.29%	EUR	100.29%	24	501 474
GS Float 09/23	1 100 000	100.73%	EUR	100.73%	320	1 108 383
UTX Float 11/19	1 500 000	100.44%	EUR	100.44%		1 506 548
CS 1.375% 11/2019	1 200 000	102.62%	EUR	102.62%	2 893	1 234 273
UBS Float 09/2019	400 000	100.72%	EUR	100.72%	112	402 996
REPSM 4.875% 02/2019	2 500 000	105.14%	EUR	105.14%	115 865	2 744 240
IBESM 4.25% 10/2018	1 200 000	103.04%	EUR	103.04%	15 789	1 252 269
ENELIM 4.875% 03/20	1 250 000	110.15%	EUR	110.15%	54 593	1 431 406
REPSM 4.375% 02/2018	1 700 000	100.21%	EUR	100.21%	70 503	1 774 107
REPSM 2.625% 05/2020	2 500 000	105.90%	EUR	105.90%	44 769	2 692 294
IBESM 2.875% 11/2020	1 000 000	107.59%	EUR	107.59%	6 459	1 082 399
ACHMEA 2.5% 11/2020	2 800 000	106.38%	EUR	106.38%	14 192	2 992 832
NOMURA 1.125% 06/20	1 000 000	102.16%	EUR	102.16%	7 490	1 029 070
ACHMEA 0.875% 09/18	4 000 000	100.67%	EUR	100.67%	13 137	4 039 777
ABNANV Float 01/19	600 000	100.43%	EUR	100.43%	48	602 652
MYL FLOAT 11/18	1 200 000	100.47%	EUR	100.47%	1 280	1 206 872
VW 0.5% 03/21	600 000	100.56%	EUR	100.56%	2 532	605 886
VW Float 03/19	600 000	100.25%	EUR	100.25%	12	601 482
BMW 0.125% 07/20	3 000 000	100.18%	EUR	100.18%	2 188	3 007 438
LPTY Float 11/20	800 000	100.62%	EUR	100.62%	369	805 289
MYL Float 05/20	800 000	100.25%	EUR	100.25%	262	802 294
PHIANA Float 09/2019	750 000	100.44%	EUR	100.44%		753 263
AKZANA Float 11/19	900 000	100.39%	EUR	100.39%		903 546
ANNGR FLOAT 11/19	500 000	100.44%	EUR	100.44%	21	502 201
ALVGR Float 12/20	300 000	101.35%	EUR	101.35%	83	304 136
LPTY Float 01/21	200 000	100.60%	EUR	100.60%	7	201 207
SYDBDC Float 05/18	500 000	100.12%	EUR	100.12%	218	500 833
NYKRE Float 06/22	1 000 000	100.91%	EUR	100.91%	395	1 009 525
JYBC Float 06/20	1 000 000	100.46%	EUR	100.46%	34	1 004 614
KBCBB Float 11/22	500 000	101.30%	EUR	101.30%	212	506 687
GE 2.875% 06/2019	1 000 000	104.01%	EUR	104.01%	17 959	1 058 049
GE 2.25% 07/2020	2 000 000	105.13%	EUR	105.13%	24 164	2 126 724
DLTAS 2008-1 A	1 074 844	99.94%	EUR	99.94%	54	1 074 296
DHR Float 06/22	700 000	100.57%	EUR	100.57%		703 962
DE Float 09/20	1 000 000	100.49%	EUR	100.49%		1 004 860
SUMIBK Float 06/22	500 000	100.64%	EUR	100.64%	84	503 284
BMO Float 09/21	750 000	101.25%	EUR	101.25%	125	759 522
BNS FLOAT 10/22	1 000 000	101.83%	EUR	101.83%	203	1 018 513
ICBCAS FLOAT 10/20	1 000 000	100.25%	EUR	100.25%	123	1 002 573
BCHINA Float 11/20	300 000	100.28%	EUR	100.28%	83	300 929
AMXLMM 4.125%10/2019	700 000	107.11%	EUR	107.11%	7 832	757 616
AMXLMM 1% 06/2018	2 500 000	100.31%	EUR	100.31%	16 575	2 524 275
CAFP FLT 03/18	700 000	100.09%	EUR	100.09%	357	700 966
GLENLN 2.625% 11/18	800 000	102.06%	EUR	102.06%	4 258	820 762
BACR Float 03/2021	900 000	96.89%	EUR	96.89%	145	872 119
CCBGBB Float 03/18	500 000	100.04%	EUR	100.04%	100	500 275
GSFloat 10/2019	50 000	101.08%	EUR	101.08%	2	50 544

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
GS Float 09/2018	500 000	100.36%	EUR	100.36%	235	502 030
BAC Float 05/2019	700 000	101.44%	EUR	101.44%	1 913	711 979
C Float 11/2019	100 000	100.84%	EUR	100.84%	49	100 890
ANNGR Float 09/18	500 000	100.15%	EUR	100.15%	37	500 777
UNANA Float 06/18	500 000	100.11%	EUR	100.11%		500 530
SOCGEN Float 02/18	200 000	100.02%	EUR	100.02%	9	200 049
BSN Float 09/2018	500 000	100.24%	EUR	100.24%	40	501 225
BATSLN Float 03/2018	500 000	100.04%	EUR	100.04%	138	500 328
RY Float 03/2019	300 000	100.51%	EUR	100.51%	36	301 557
RY Float 10/2018	500 000	100.33%	EUR	100.33%	14	501 649
DAIGR Float 01/2019	200 000	100.41%	EUR	100.41%	22	200 846
DAIGR Float 03/18	100 000	100.03%	EUR	100.03%	22	100 056
VOD Float 02/2019	200 000	100.98%	EUR	100.98%	228	202 188
RENAUL Float 03/19	600 000	101.00%	EUR	101.00%	502	606 478
NDASS Float 02/19	200 000	100.48%	EUR	100.48%	48	201 010
ENELIM Float 02/2018	500 000	100.15%	EUR	100.15%	6 444	507 209
CAT Float 05/2018	200 000	100.06%	EUR	100.06%		200 120
UCGIM Float 02/2020	650 000	101.60%	EUR	101.60%	884	661 265
MAERSK Float 03/19	200 000	101.61%	EUR	101.61%	317	203 537
HON Float 02/18	100 000	100.03%	EUR	100.03%	34	100 065
COVEGR Float 03/18	200 000	100.05%	EUR	100.05%	79	200 179
FDX Float 04/19	300 000	100.51%	EUR	100.51%	39	301 554
CAPFP Float 07/2018	700 000	100.13%	EUR	100.13%	304	701 228
VW Float 07/2018	100 000	100.11%	EUR	100.11%		100 108
F Float 02/2018	500 000	100.01%	EUR	100.01%	163	500 203
BPCEGP Float 05/2018	500 000	100.22%	EUR	100.22%	299	501 374
ISPIM Float 04/2019	600 000	101.08%	EUR	101.08%	180	606 654
ISPIM Float 06/20	200 000	101.94%	EUR	101.94%	192	204 074
INTNED Float 02/18	200 000	100.03%	EUR	100.03%	69	200 121
NWIDE Float 11/2018	700 000	100.37%	EUR	100.37%	299	702 882
BMW Float 04/2018	700 000	100.06%	EUR	100.06%		700 392
SWEDA FLOAT 03/19	200 000	100.84%	EUR	100.84%	123	201 799
						162 349 063
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					25 668	7 108 676
Obrigações diversas						
HUWY 1.375% 10/2021	2 000 000	103.29%	EUR	103.29%	7 007	2 072 807
K 1.75% 05/2021	1 000 000	104.59%	EUR	104.59%	12 130	1 058 070
KO Float 03/19	300 000	100.36%	EUR	100.36%		301 068
UBS Float 09/22	1 000 000	101.52%	EUR	101.52%	443	1 015 593
AGN Float 06/19	1 000 000	100.18%	EUR	100.18%	36	1 001 836
WESAU 1.25% 10/2021	1 500 000	103.51%	EUR	103.51%	6 010	1 558 600
AT&T Float 06/19	100 000	100.66%	EUR	100.66%	41	100 701
						7 108 676
						184 308 618

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2018-01-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
OIC domiciliados em Portugal						36 973 709
CXG OBRIGAÇÕES	2 258 307	4.49	EUR	4.49		10 133 925
CXG LIQUIDEZ	5 021 569	5.34	EUR	5.34		26 839 784
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						24 939 500
AXA WF EUR SD-I-XC€	248 649	100.30	EUR	100.30		24 939 500
						61 913 208
LIQUIDEZ						
À vista						7 153 895
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			7 153 895
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
Valores Passivos						-266 911
						-266 911
						253 108 811

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO 42 849 805.92

Valor da Unidade de Participação: € 5.9069