

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
 Composição da Carteira em 2013-07-31

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.					2 151	89 353
Títulos de Dívida Pública						
OT 3.6% OUT/2014	31 000	100.07%	EUR	100.07%	887	31 908
Obrigações diversas						
SANTAN 3.25% 10/2014	50 000	101.22%	EUR	101.22%	1 264	51 876
Acções						
J.MARTINS-PO	375	14.85	EUR	14.85		5 569
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					23 330	3 819 146
Títulos de Dívida Pública						
DBR 6.25% 01/2024	35 000	143.35%	EUR	143.35%	1 253	51 425
DBR 4% 04/01/37	35 000	127.51%	EUR	127.51%	802	45 430
DBR 3.75% 01/2017	61 000	111.62%	EUR	111.62%	1 310	69 395
OBL 4% 10/2013	30 000	100.74%	EUR	100.74%	967	31 187
DBR 1.75% 07/04/22	38 000	102.11%	EUR	102.11%	51	38 851
FRTR 3.25% 25/4/2016	60 000	107.60%	EUR	107.60%	524	65 081
FRANCE O.A.T 4.25	26 000	114.01%	EUR	114.01%	848	30 490
FRTR 4.5% 04/2041	57 000	122.83%	EUR	122.83%	689	70 699
FRTR 3% 04/2022	86 000	107.72%	EUR	107.72%	693	93 332
SPGB 4.8% 01/2024	93 000	100.62%	EUR	100.62%	2 226	95 798
SPGB 5.5% 04/2021	57 000	108.32%	EUR	108.32%	799	62 538
BTPS 3.75% 12/2013	36 000	101.10%	EUR	101.10%	173	36 568
BTPS 5% 09/2040	48 000	99.50%	EUR	99.50%	998	48 758
BTPS 5% 03/2025	48 000	103.96%	EUR	103.96%	998	50 899
BTPS 3.75% 08/2016	115 000	103.82%	EUR	103.82%	2 156	121 549
BTPS 3% 11/2015	41 000	102.14%	EUR	102.14%	308	42 183
BTPS 5.5% 09/2022	78 000	108.70%	EUR	108.70%	1 784	86 570
NETHER 3.75% 01/23	74 000	115.87%	EUR	115.87%	1 505	87 249
BGB 3.5% 06/2017	97 000	109.69%	EUR	109.69%	316	106 716
RAGB 4.85 03/2026	40 000	127.87%	EUR	127.87%	739	51 885
RAGB 3.5% 07/2015	49 000	106.38%	EUR	106.38%	80	52 204
						1 338 805
Obrigações diversas						
CMZB Float 10/2013	30 000	100.32%	EUR	100.32%	10	30 105
CGD S.758 12/2017	650 000	75.91%	EUR	75.91%	1 454	494 842
CXGD 8% 09/2015	32 000	106.13%	EUR	106.13%	2 153	36 113
UAB S.11 10/2013	57 408	88.54%	EUR	88.54%	20	50 851
SANTAN Float 10/2013	50 000	100.28%	EUR	100.28%	7	50 148
LLOYDS BANK Float 16	10 000	96.44%	EUR	96.44%	7	9 650
BNP Float 12/2014	50 000	100.20%	EUR	100.20%	47	50 149
MS Float 04/2016	50 000	98.44%	EUR	98.44%	15	49 237
BAC Float 02/2014	50 000	99.99%	EUR	99.99%	42	50 034
Citigroup Flt.03/14	50 000	100.00%	EUR	100.00%	27	50 025

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2013-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
UBS Float 05/2014	20 000	100.37%	EUR	100.37%	30	20 103
DB Float 09/2016	15 000	97.51%	EUR	97.51%	18	14 644
GE Float 02/2016	25 000	99.24%	EUR	99.24%	17	24 826
ENELIM Float 01/2015	50 000	99.77%	EUR	99.77%	27	49 913
ENELIM Float 02/2016	30 000	98.34%	EUR	98.34%	141	29 642
BAVB Float 10/14	30 000	98.80%	EUR	98.80%	11	29 649
UCGIM Float 02/2014	30 000	99.72%	EUR	99.72%	26	29 941
UBIIM Float 07/2014	50 000	99.06%	EUR	99.06%	4	49 532
RABOBK Float 01/2014	10 000	100.29%	EUR	100.29%	4	10 034
BPCEGP Float 10/2013	50 000	100.18%	EUR	100.18%	4	50 094
Intned Float 03/2016	15 000	95.42%	EUR	95.42%	16	14 329
Intned Float 04/2016	50 000	98.94%	EUR	98.94%	12	49 483
JPM Float 09/2013	50 000	100.04%	EUR	100.04%	24	50 044
						1 293 388
Ações						
BMW	365	73.59	EUR	73.59		26 860
DEUTSCHE BANK	741	33.91	EUR	33.91		25 124
SIEMENS	626	82.31	EUR	82.31		51 526
ALLIANZ	281	117.20	EUR	117.20		32 933
E.ON AG(EX VEBAG)	1 002	12.76	EUR	12.76		12 781
BASF	620	66.66	EUR	66.66		41 329
BAYER AG	414	87.35	EUR	87.35		36 163
MUNCHENER RUCKVERS.	107	149.20	EUR	149.20		15 964
ADIDAS- SALOMON AG	262	83.80	EUR	83.80		21 956
BEIERSDORF AG	292	69.52	EUR	69.52		20 300
HENKEL KGAA PREF.	259	73.64	EUR	73.64		19 073
SAP ORD.	406	55.29	EUR	55.29		22 448
THYSSEN KRUPP	591	16.35	EUR	16.35		9 663
FRESENIUS MEDICAL CA	219	47.59	EUR	47.59		10 421
VOLKSWAGEN AG-PREF.	197	178.65	EUR	178.65		35 194
OSRAM LICHT AG	62	29.23	EUR	29.23		1 812
GEN DES EAUX/VIVENDI	839	16.06	EUR	16.06		13 474
DANONE	404	59.40	EUR	59.40		23 998
AXA-UAP	489	16.58	EUR	16.58		8 105
CARREFOUR	256	23.07	EUR	23.07		5 906
TOTAL SA	892	40.10	EUR	40.10		35 769
Kering	42	172.10	EUR	172.10		7 228
BNP	673	48.64	EUR	48.64		32 731
AIR LIQUIDE	129	99.78	EUR	99.78		12 872
L.V.M.H.	81	136.65	EUR	136.65		11 069
MICHELIN	129	75.48	EUR	75.48		9 737
RENAULT SA	274	59.17	EUR	59.17		16 213
SOCIETE GENERALE	727	30.22	EUR	30.22		21 966
GLE ENTREP. VINCI	702	40.59	EUR	40.59		28 494
SANOFI SYNHLABO	671	80.17	EUR	80.17		53 794
EADS	719	44.89	EUR	44.89		32 272

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2013-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
SUEZ ENVIRONNEMENT S	721	10.66	EUR	10.66		7 682
EDF	275	22.06	EUR	22.06		6 065
LLOYDS BANK	8 519	0.68	GBP	0.78		6 678
BARCLAYS	3 092	2.88	GBP	3.30		10 191
WEIR GROUP PLC	240	21.49	GBP	24.60		5 905
DE LA RUE PLC	269	9.89	GBP	11.32		3 044
AFREN PLC	5 626	1.36	GBP	1.56		8 759
ASHTED GROUP PLC	1 656	7.06	GBP	8.08		13 384
JAZZTEL PLC	1 357	6.82	EUR	6.82		9 255
BANCO POPULAR	4 529	3.31	EUR	3.31		14 968
TELEFONICA	2 648	10.72	EUR	10.72		28 373
BCO SANTANDER C.HISP	6 483	5.49	EUR	5.49		35 618
GAS NATURAL	494	15.30	EUR	15.30		7 558
IBERDROLA	2 683	4.15	EUR	4.15		11 134
REPSOL	883	17.99	EUR	17.99		15 885
BCO. BILBAO VISCAYA	2 079	7.12	EUR	7.12		14 798
FERROVIAL	1 487	12.80	EUR	12.80		19 034
DISTR.INTERNACIONAL	1 074	6.23	EUR	6.23		6 689
UNICREDITO ITALIANO	1 589	4.09	EUR	4.09		6 502
ENI SPA	925	16.61	EUR	16.61		15 364
BANCA INTESA	4 944	1.43	EUR	1.43		7 050
TERNA SPA	2 316	3.35	EUR	3.35		7 759
AEGON NV	3 044	5.80	EUR	5.80		17 640
ING GROEP NV	2 824	7.68	EUR	7.68		21 688
UNILEVER NV-CVA	599	30.24	EUR	30.24		18 114
ASML NA	219	67.60	EUR	67.60		14 804
AKZO NOBEL NV NLG20	465	45.76	EUR	45.76		21 276
SBM OFFSHORE NV	547	14.55	EUR	14.55		7 959
NOKIA A	3 346	2.95	EUR	2.95		9 871
UPM-KYMMENE	2 466	8.39	EUR	8.39		20 677
Neste Oil Oyj	935	10.89	EUR	10.89		10 182
SOLVAY SA	109	101.80	EUR	101.80		11 096
ANHEUSER-BUSCH INB	714	72.38	EUR	72.38		51 679
BELGACOM SA	858	18.43	EUR	18.43		15 809
OMV AG	219	33.27	EUR	33.27		7 285
						1 186 952
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU						55 434
Acções						
NOVARTIS REG	225	66.60	CHF	54.07		12 166
C.S.HOLD./GROUP-REG	347	27.19	CHF	22.08		7 660
C.FIN.RICHMONT	264	90.60	CHF	73.56		19 419
MARINE HARVEST	21 436	5.94	NOK	0.76		16 188
						55 434
						3 963 932

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
 Composição da Carteira em 2013-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
OIC domiciliados em Portugal						833 913
UPs de OIC abertos						
CXG OB MAIS MENSAL	37 127	4.16	EUR	4.16		154 613
CXG IMOBILIARIO	53 412	3.25	EUR	3.25		173 765
FEI CX F. MONETARIO	29 495	5.49	EUR	5.49		162 049
F.I.MOB.IMOSOCIAL	16 827	6.34	EUR	6.34		106 698
IBERIA F.INV.IMOB	4 595	0.00	EUR	0.00		3
FUNDIESTAMO I	58	1 017.93	EUR	1 017.93		59 040
Fnd I.Imob. MAXIRENT	7 207	11.86	EUR	11.86		85 480
LOGISTICA E DISTRIB.	16 788	5.50	EUR	5.50		92 263
						833 913
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						2 005 192
UPs de OIC harmonizados						
HSBC EURO GVT BOND F	66	2 812.50	EUR	2 812.50		185 625
PETERCAM BdEUR InG-F	5 100	57.50	EUR	57.50		293 250
BROCK EURO MKT Fd D2	17 523	21.34	EUR	21.34		373 941
BNPP L1 EQTY EURO I	1 229	295.95	EUR	295.95		363 723
PIONEER EUROLND EQ I	65 237	6.21	EUR	6.21		405 122
ROBECO EUR GOV BD I	770	138.99	EUR	138.99		107 022
ALLIANZ EUROLND EQY G	120	1 575.45	EUR	1 575.45		189 054
ISHARES EUROP MINVOL	3 200	27.33	EUR	27.33		87 456
						2 005 192
						2 839 105
LIQUIDEZ						
À vista					10	10
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.0984%			EUR		10	10
A prazo					21 023	1 584 023
Depósitos com pré aviso e a prazo						
DP DP CGD 4/7 368D 2.7500% 2013-07-04 a 2014-07-07			EUR		364	170 364
DP DP CGD 01/02 354d 2.9500% 2013-02-01 a 2014-01-21			EUR		1 083	74 083
DP DP CGD 27/06 363d 2.7500% 2013-06-27 a 2014-06-25			EUR		668	250 668
DP DP CGD 29/07 365d 2.7500% 2013-07-29 a 2014-07-29			EUR		18	80 018
DP DP CGD 28/9 368d 2.9000% 2012-09-28 a 2013-10-01			EUR		2 473	102 473
DP DP CGD 30-10 395d 3.1500% 2012-10-30 a 2013-11-29			EUR		722	30 722
DP DP CGD 28/03 391d 3.0000% 2013-03-28 a 2014-04-23			EUR		1 680	161 680
DP DP CGD 21/12 364d 3.0500% 2012-12-21 a 2013-12-20			EUR		8 974	483 974
DP DP CGD 10/10 359d 3.0000% 2012-10-10 a 2013-10-04			EUR		3 688	153 688
DP DP CGD 31/12 354d 3.0500% 2012-12-31 a 2013-12-20			EUR		1 353	76 353
						1 584 023
						1 584 033
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
Valores Activos						126 709

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2013-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
Valores Passivos						-8 663
						118 046
						8 505 116
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
VGU3-EUR EUX09/2013	5	2 767.00	EUR	2 767.00		138 350
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					1 593 044.47	

Valor da Unidade de Participação 5.3389 €