

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
 Composição da Carteira em 2018-08-31

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.					5 718	2 313 404
Obrigações diversas						
TAGST 09-ENGY A1/25	715 673	102.08%	EUR	102.08%	597	731 156
CXGD 1% 01/2022	700 000	102.23%	EUR	102.23%	4 162	719 758
VERSE 3 SNR 02/2019	539 191	100.43%	EUR	100.43%	566	542 075
VERSE 4 SNR 02/2021	313 608	102.05%	EUR	102.05%	393	320 414
						2 313 404
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					724 649	99 431 426
Titulos de Dívida Pública						
FADE 0.031% 06/2020	5 400 000	100.26%	EUR	100.26%	349	5 414 119
Obrigações diversas						
NOSPL 1.125% 05/23	2 500 000	100.30%	EUR	100.30%	9 401	2 516 976
DAIGR Float 07/24	1 000 000	99.38%	EUR	99.38%	215	993 995
BASGR Float 11/19	1 300 000	100.29%	EUR	100.29%		1 303 705
SAPGR Float 03/21	1 100 000	100.43%	EUR	100.43%		1 104 774
COFP 4.481% 11/2018	6 000 000	99.15%	EUR	99.15%	276 030	6 224 790
RENAUL 1.125% 09/19	1 200 000	101.18%	EUR	101.18%	12 427	1 226 635
MCFP 1% 09/2021	1 400 000	102.77%	EUR	102.77%	13 118	1 451 828
RENAULT Float 08/20	100 000	100.18%	EUR	100.18%	19	100 203
BPCEGP Float 03/22	500 000	101.28%	EUR	101.28%	830	507 225
RENAULT Float 04/21	100 000	100.43%	EUR	100.43%	47	100 479
ACAFP Float 04/22	1 000 000	100.50%	EUR	100.50%	572	1 005 592
MCFP 0% 05/20	4 300 000	100.12%	EUR	100.12%		4 305 246
BNP Float 06/24	800 000	99.96%	EUR	99.96%	818	800 458
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.12%	EUR	100.12%	306	400 794
GFCFP Float 06/22	800 000	99.78%	EUR	99.78%	80	798 312
ALDFP Float 11/20	500 000	100.02%	EUR	100.02%	8	500 103
SANFP Float 03/20	900 000	100.34%	EUR	100.34%		903 096
BNP Float 05/23	500 000	99.54%	EUR	99.54%	42	497 742
ABBAY 2.625% 07/2020	750 000	104.79%	EUR	104.79%	2 535	788 490
ABBAY 0.875% 01/2020	500 000	101.19%	EUR	101.19%	2 769	508 739
LLOYDS 0.625% 04/20	1 500 000	101.12%	EUR	101.12%	3 442	1 520 302
HSBC Float 09/22	750 000	100.52%	EUR	100.52%	517	754 387
F Float 08/20	300 000	99.78%	EUR	99.78%	6	299 349
WPPLN Float 05/20	800 000	100.06%	EUR	100.06%	0	800 512
SANUK Float 05/23	500 000	99.50%	EUR	99.50%	77	497 567
RBS Float 06/20	900 000	100.04%	EUR	100.04%	232	900 583
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	99.74%	EUR	99.74%	914	998 294
HSBC 0.17% 10/23	500 000	99.70%	EUR	99.70%	144	498 654
RBS Float 03/2020	100 000	100.00%	EUR	100.00%	20	100 020
GSK Float 05/20	500 000	100.33%	EUR	100.33%		501 665
TELEFO 4.693% 11/19	1 000 000	105.52%	EUR	105.52%	37 801	1 093 011
REDELE 4.875% 04/202	1 000 000	108.07%	EUR	108.07%	16 695	1 097 405

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
IBESM Float 02/24	1 100 000	100.90%	EUR	100.90%	129	1 110 078
SANTAN Float 03/22	600 000	101.08%	EUR	101.08%	836	607 316
CRUNAV Float 06/2022	500 000	99.70%	EUR	99.70%	327	498 827
VLVY 2.375% 11/26/19	250 000	102.91%	EUR	102.91%	4 539	261 824
SCANIA Float 04/20	500 000	100.19%	EUR	100.19%	47	500 987
ENIIM 4.25% 02/20	700 000	105.92%	EUR	105.92%	17 116	758 542
ISPIM 1.125% 01/2020	1 600 000	100.36%	EUR	100.36%	11 342	1 617 150
ISPIM 4.125% 04/2020	750 000	105.09%	EUR	105.09%	11 866	800 064
ISPIM 2% 06/2021	1 000 000	101.96%	EUR	101.96%	4 110	1 023 740
ISPIM Float 04/22	450 000	97.29%	EUR	97.29%	346	438 155
GS 5.125% 10/2019	1 200 000	105.82%	EUR	105.82%	52 738	1 322 614
BAC 2.5% 07/2020	750 000	104.82%	EUR	104.82%	1 849	788 022
MS Float 01/22	500 000	100.39%	EUR	100.39%	190	502 120
MS Float 03/12/2019	200 000	100.07%	EUR	100.07%	89	200 233
BAC Float 02/22	200 000	100.79%	EUR	100.79%	67	201 649
BAC Float 05/23	400 000	100.58%	EUR	100.58%	133	402 457
GM Float 05/21	1 800 000	100.46%	EUR	100.46%	397	1 808 659
BATSLN Float 08/21	500 000	100.03%	EUR	100.03%	40	500 165
BAC Float 09/21	500 000	99.94%	EUR	99.94%	47	499 752
GS Float 09/23	1 100 000	99.19%	EUR	99.19%	608	1 091 742
UTX Float 11/19	1 500 000	100.13%	EUR	100.13%		1 502 010
T Float 09/2023	1 500 000	101.00%	EUR	101.00%	1 962	1 516 902
MS Float 05/21	500 000	99.93%	EUR	99.93%	12	499 682
CS 1.375% 11/2019	1 200 000	101.86%	EUR	101.86%	12 477	1 234 845
UBS Float 04/2021	200 000	100.55%	EUR	100.55%	40	201 144
ENELIM 4.875% 03/20	1 250 000	107.32%	EUR	107.32%	29 050	1 370 587
REPSM 2.625% 05/2020	2 500 000	104.41%	EUR	104.41%	17 260	2 627 610
IBESM 2.875% 11/2020	1 000 000	106.22%	EUR	106.22%	23 158	1 085 388
RENEPL 4.75% 10/2020	1 000 000	109.41%	EUR	109.41%	41 644	1 135 764
ACHMEA 2.5% 11/2020	2 800 000	105.13%	EUR	105.13%	54 849	2 998 545
NOMURA 1.125% 06/20	1 000 000	102.00%	EUR	102.00%	2 774	1 022 774
MYL FLOAT 11/18	1 200 000	100.13%	EUR	100.13%	184	1 201 792
BMW 0.125% 07/20	3 000 000	100.32%	EUR	100.32%	616	3 010 096
LPTY Float 11/20	800 000	100.36%	EUR	100.36%	116	802 972
MYL Float 05/20	800 000	100.12%	EUR	100.12%	32	800 968
AKZANA Float 11/19	900 000	100.22%	EUR	100.22%		901 962
ANNGR FLOAT 11/19	500 000	100.19%	EUR	100.19%	5	500 955
ALVGR Float 12/20	300 000	100.91%	EUR	100.91%	128	302 855
LPTY Float 01/21	200 000	100.34%	EUR	100.34%	38	200 724
ADNA Float 03/21	200 000	100.06%	EUR	100.06%		200 118
DAIGR Float 04/20	300 000	100.43%	EUR	100.43%	81	301 383
TOYOTA FLT 04/27	500 000	99.93%	EUR	99.93%	15	499 665
BAYNGR 0.625% 12/22	100 000	100.31%	EUR	100.31%	115	100 429
BAYNGR Float 06/22	300 000	100.32%	EUR	100.32%	127	301 072
ABNANV 0.5% 07/2023	2 000 000	99.76%	EUR	99.76%	1 260	1 996 440
NIBCAP Float 07/20	900 000	100.12%	EUR	100.12%	149	901 202
NYKRE Float 06/22	1 000 000	99.89%	EUR	99.89%	616	999 536

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
JYBC Float 06/20	1 000 000	100.30%	EUR	100.30%	72	1 003 092
MINGNO 0.75% 03/23	2 000 000	99.84%	EUR	99.84%	2 466	1 999 346
CBSBKF Float 03/21	600 000	100.29%	EUR	100.29%	254	601 964
KBCBB Float 11/22	500 000	99.83%	EUR	99.83%	26	499 191
GE 2.25% 07/2020	2 000 000	104.21%	EUR	104.21%	5 301	2 089 441
DLTAS 2008-1 A	960 816	99.50%	EUR	99.50%	48	956 032
DHR Float 06/22	700 000	99.93%	EUR	99.93%		699 482
DE Float 09/20	1 000 000	100.19%	EUR	100.19%		1 001 850
SUMIBK Float 06/22	500 000	99.77%	EUR	99.77%	142	498 992
BNS FLOAT 10/22	1 000 000	101.04%	EUR	101.04%	450	1 010 800
BCHINA Float 11/20	300 000	99.88%	EUR	99.88%	13	299 653
AMXLMM 4.125%10/2019	700 000	104.61%	EUR	104.61%	24 603	756 901
GLENLN 2.625% 11/18	800 000	100.45%	EUR	100.45%	16 455	820 079
BACR Float 03/2021	900 000	96.38%	EUR	96.38%	261	867 694
GSFloat 10/2019	50 000	100.60%	EUR	100.60%	20	50 318
BAC Float 05/2019	700 000	100.68%	EUR	100.68%	577	705 323
C Float 11/2019	100 000	100.47%	EUR	100.47%	12	100 480
RY Float 03/2019	300 000	100.22%	EUR	100.22%	69	300 735
RY Float 10/2018	500 000	100.06%	EUR	100.06%	61	500 346
ISPIM Float 04/2019	600 000	100.14%	EUR	100.14%	559	601 399
ISPIM Float 06/20	200 000	99.97%	EUR	99.97%	316	200 254
SWEDA FLOAT 08/2020	200 000	100.74%	EUR	100.74%	12	201 494
						94 017 308
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					45 456	6 001 196
Obrigações diversas						
HUWY 1.375% 10/2021	2 000 000	102.91%	EUR	102.91%	22 979	2 081 259
K 1.75% 05/2021	1 000 000	104.10%	EUR	104.10%	4 795	1 045 775
F Float 05/21	300 000	99.32%	EUR	99.32%	17	297 962
UBS Float 09/22	1 000 000	100.46%	EUR	100.46%	764	1 005 344
WESAU 1.25% 10/2021	1 500 000	103.60%	EUR	103.60%	16 901	1 570 856
						6 001 196
						107 746 026

OUTROS VALORES

Outros Intrumentos de Dívida					1 465	6 851 465
Papel Comercial						
PC P.COM.C.AMORIM 10ºEM 0.0800% 2018-08-31 a 2018-09-28			EUR		7	3 000 007
PC P.COM.SONAE 882º EM. 0.1500% 2018-08-30 a 2018-10-15			EUR		17	2 000 017
PC PC.JMS 35º 30/07 0.8500% 2018-07-30 a 2018-09-14			EUR		1 441	1 851 441
						6 851 465
						6 851 465

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						32 568 577
CXG OBRIGAÇÕES	2 258 307	4.45	EUR	4.45		10 053 981
CXG LIQUIDEZ	4 224 285	5.33	EUR	5.33		22 514 596

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2018-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						24 817 661
AXA WF EUR SD-I-XC€	248 649	99.81	EUR	99.81		24 817 661
						57 386 238

LIQUIDEZ

À vista						15 555 860
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			15 380 704
DO EUR-RBS (GR+ 0.0000%			EUR			165 155
DO SANTANDER - 0.0000%			EUR			5 000
DO BCP - EUR 0.0000%			EUR			5 000
						15 555 860
A prazo					15 355	42 015 355
Depósitos com pré aviso e a prazo						
DP DP BCP 05JUN 365D 0.1200% 2018-06-05 a 2019-06-05			EUR		4 400	15 004 400
DP DP BCP 12JUL 365D 0.1800% 2018-07-12 a 2019-07-12			EUR		1 275	5 001 275
DP DP SANTANDER 05JUN 0.1800% 2018-06-05 a 2019-06-05			EUR		9 680	22 009 680
						42 015 355
						57 571 215

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						105 412
Valores Passivos						-162 145
						-56 733
						229 498 210

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

Em mercado regulamentado

Futuros

OEU8 EUR EUX 09/18	-94	132.26	EUR	132.26		-12 432 440
--------------------	-----	--------	-----	--------	--	-------------

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

39 033 605.19

Valor da Unidade de Participação: € 5.8795