

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
 Composição da Carteira em 2017-09-30

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.					124 557	11 333 397
Títulos de Dívida Pública						
OT 4.8% 06/2020	1 250 000	112.48%	EUR	112.48%	17 753	1 423 803
OT 3.85% 04/2021	1 750 000	112.10%	EUR	112.10%	31 196	1 992 998
OT 4.75% 06/2019	2 000 000	108.09%	EUR	108.09%	28 370	2 190 070
						5 606 871
Obrigações diversas						
CXGD 3% 01/2019	600 000	103.83%	EUR	103.83%	12 773	635 741
VERSE 2 SNR 02/2018	537 229	100.54%	EUR	100.54%	619	540 772
TAGST 09-ENGY A1/25	810 709	101.85%	EUR	101.85%	675	826 383
CXGD 1% 01/2022	700 000	101.39%	EUR	101.39%	4 737	714 453
VERSE 3 SNR 02/2019	1 513 891	101.25%	EUR	101.25%	1 590	1 534 405
VERSE 4 SNR 02/2021	423 925	103.03%	EUR	103.03%	542	437 291
CXGD 3.75% 01/2018	1 000 000	101.12%	EUR	101.12%	26 301	1 037 481
						5 726 525
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					1 829 536	167 380 701
Títulos de Dívida Pública						
FADE 0.031% 06/2020	5 400 000	100.11%	EUR	100.11%	491	5 406 323
Obrigações diversas						
RENEPL 4.125% 01/18	500 000	101.34%	EUR	101.34%	13 731	520 436
DAIGR Float 07/24	1 000 000	100.07%	EUR	100.07%	298	1 000 988
VW Float 07/19	1 100 000	100.04%	EUR	100.04%	56	1 100 529
COFP 4.481% 11/2018	6 000 000	106.17%	EUR	106.17%	237 923	6 608 063
LGFP 5.375% 11/2018	5 000 000	106.18%	EUR	106.18%	225 308	5 534 258
MWDP 6.75% 04/2018	4 000 000	103.65%	EUR	103.65%	121 315	4 267 395
COFP 3.994 03/2020	1 000 000	111.67%	EUR	111.67%	22 541	1 139 281
PPFP 3.125% 04/2019	1 200 000	105.05%	EUR	105.05%	16 541	1 277 129
RENAUL 1.125% 09/19	1 200 000	102.26%	EUR	102.26%	37	1 227 193
MCFP 1% 09/2021	1 400 000	103.32%	EUR	103.32%	268	1 446 734
BPCEGP 5.1% 06/2018	1 480 000	103.79%	EUR	103.79%	829	1 536 892
RENAUL 3.625% 09/18	2 000 000	103.54%	EUR	103.54%	2 384	2 073 144
KERFP 1.875% 10/2018	1 500 000	102.04%	EUR	102.04%	27 586	1 558 201
BPCEGP 3.7% 05/2018	2 530 000	102.27%	EUR	102.27%	12 210	2 599 692
BNFP Float 11/18	400 000	100.24%	EUR	100.24%		400 968
RENAULT Float 08/20	100 000	100.38%	EUR	100.38%	28	100 409
BPCEGP Float 03/22	500 000	103.00%	EUR	103.00%	200	515 200
RENAULT Float 04/21	100 000	100.72%	EUR	100.72%	72	100 788
ACAFP Float 04/22	1 000 000	102.06%	EUR	102.06%	951	1 021 541
MCFP 0% 05/20	4 300 000	100.14%	EUR	100.14%		4 305 805
MCFP Float 11/18	465 000	100.31%	EUR	100.31%		466 451
BNP Float 06/24	800 000	101.29%	EUR	101.29%	225	810 561
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.91%	EUR	100.91%	64	403 704
GFCFP Float 06/22	800 000	100.13%	EUR	100.13%		801 064

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2017-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ABBEY 2.625% 07/2020	750 000	106.98%	EUR	106.98%	4 153	806 488
LLOYDS 1.875% 10/18	1 500 000	102.15%	EUR	102.15%	27 432	1 559 682
ABBEY 2% 01/2019	1 000 000	102.73%	EUR	102.73%	14 247	1 041 537
DGELN 1.125% 05/2019	1 000 000	101.91%	EUR	101.91%	4 130	1 023 220
F 1.75% 05/18	5 000 000	101.14%	EUR	101.14%	31 884	5 088 684
ABBEY 0.875% 01/2020	500 000	101.87%	EUR	101.87%	3 128	512 478
LLOYDS 0.625% 04/20	1 500 000	101.64%	EUR	101.64%	4 212	1 528 827
HSBC Float 09/22	750 000	101.43%	EUR	101.43%	31	760 756
F Float 08/20	300 000	100.39%	EUR	100.39%	47	301 205
WPPLN Float 05/20	800 000	100.20%	EUR	100.20%		801 560
SANUK Float 05/23	500 000	100.86%	EUR	100.86%	276	504 566
RBS Float 06/20	900 000	100.49%	EUR	100.49%	58	904 468
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	101.03%	EUR	101.03%	125	1 010 395
TELEFO 4.693% 11/19	1 000 000	109.90%	EUR	109.90%	41 658	1 140 678
REDELE 4.875% 04/202	1 000 000	112.59%	EUR	112.59%	20 702	1 146 612
TELEFO 4.797 02/2018	5 000 000	101.90%	EUR	101.90%	145 881	5 240 631
CABKSM 3.125% 05/18	4 000 000	102.00%	EUR	102.00%	47 945	4 127 785
SANTAN 1.1% 07/2018	2 000 000	101.07%	EUR	101.07%	3 858	2 025 158
SANSCF Float 01/19	600 000	100.19%	EUR	100.19%	163	601 288
IBESM Float 02/24	1 100 000	100.95%	EUR	100.95%	427	1 110 899
SANTAN Float 03/22	600 000	101.63%	EUR	101.63%	115	609 889
BBVASM Float 04/22	1 200 000	101.22%	EUR	101.22%	726	1 215 366
CRUNAV Float 06/2022	500 000	100.28%	EUR	100.28%	44	501 424
VLVY 2.375% 11/26/19	250 000	105.13%	EUR	105.13%	5 027	267 857
SCANIA Float 10/18	500 000	100.23%	EUR	100.23%	17	501 187
SCANIA Float 04/20	500 000	100.34%	EUR	100.34%	70	501 785
ENIIM 4.25% 02/20	700 000	109.84%	EUR	109.84%	19 562	788 421
ISPIM 4% 11/2017	2 000 000	100.41%	EUR	100.41%	71 452	2 079 632
ENELIM 4.875% 02/18	2 900 000	101.94%	EUR	101.94%	86 374	3 042 663
ISPIM 1.125% 01/2020	1 600 000	102.33%	EUR	102.33%	12 822	1 650 134
ISPIM 4.125% 04/2020	750 000	110.07%	EUR	110.07%	14 409	839 949
UCGIM 5% 05/2018	475 000	103.14%	EUR	103.14%	8 654	498 581
UCGIM 5.65% 08/2018	1 000 000	104.92%	EUR	104.92%	5 882	1 055 087
UCGIM 6.1% 03/2018	600 000	102.77%	EUR	102.77%	19 955	636 575
UCGIM 1.8% 12/2017	1 700 000	100.59%	EUR	100.59%	23 696	1 733 803
ISPIM Float 04/22	450 000	102.29%	EUR	102.29%	574	460 870
GS 5.125% 10/2019	1 200 000	110.55%	EUR	110.55%	57 793	1 384 345
MS 2.25% 03/2018	2 000 000	101.10%	EUR	101.10%	25 027	2 047 007
BAC 2.5% 07/2020	750 000	106.77%	EUR	106.77%	3 390	804 128
JPM Float 06/2018	650 000	100.22%	EUR	100.22%		651 404
MS Float 01/22	500 000	101.03%	EUR	101.03%	340	505 475
MS Float 03/12/2019	200 000	100.34%	EUR	100.34%	25	200 699
BAC Float 02/22	200 000	101.34%	EUR	101.34%	144	202 822
GS Float 09/22	500 000	100.42%	EUR	100.42%	83	502 168
BAC Float 05/23	400 000	101.05%	EUR	101.05%	289	404 493
MS Float 11/22	600 000	101.04%	EUR	101.04%	334	606 556
GM Float 05/21	1 200 000	100.57%	EUR	100.57%	610	1 207 486

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2017-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
T Float 09/2023	1 500 000	101.89%	EUR	101.89%	564	1 528 974
TMO Float 07/2019	1 500 000	100.26%	EUR	100.26%		1 503 960
BATSLN Float 08/21	500 000	100.48%	EUR	100.48%	109	502 504
BAC Float 09/21	500 000	99.98%	EUR	99.98%	6	499 901
CS 1.375% 11/2019	1 200 000	103.00%	EUR	103.00%	13 833	1 249 821
UBS Float 09/2019	400 000	100.84%	EUR	100.84%	49	403 401
REPSM 4.875% 02/2019	2 500 000	106.78%	EUR	106.78%	74 795	2 744 195
IBESM 4.25% 10/2018	1 200 000	104.48%	EUR	104.48%	49 603	1 303 411
ENELIM 4.875% 03/20	1 250 000	111.93%	EUR	111.93%	34 058	1 433 121
REPSM 4.375% 02/2018	1 700 000	101.71%	EUR	101.71%	45 440	1 774 442
ACHMEA 2% 01/2018	1 300 000	100.68%	EUR	100.68%	17 879	1 326 680
REPSM 2.625% 05/2020	2 500 000	106.71%	EUR	106.71%	22 654	2 690 304
IBESM 2.875% 11/2020	1 000 000	108.77%	EUR	108.77%	25 521	1 113 231
ACHMEA 2.5% 11/2020	2 800 000	107.07%	EUR	107.07%	60 603	3 058 675
NOMURA 1.125% 06/20	1 000 000	102.54%	EUR	102.54%	3 699	1 029 069
ACHMEA 0.875% 09/18	4 000 000	100.97%	EUR	100.97%	1 342	4 040 182
ABNANV Float 01/19	600 000	100.55%	EUR	100.55%	223	603 535
MYL FLOAT 11/18	1 200 000	100.45%	EUR	100.45%	721	1 206 121
VW 0.5% 03/21	600 000	100.25%	EUR	100.25%	1 521	603 045
VW Float 03/19	600 000	100.09%	EUR	100.09%	1	600 553
BMW 0.125% 07/20	3 000 000	100.29%	EUR	100.29%	925	3 009 475
LPTY Float 11/20	800 000	100.49%	EUR	100.49%	244	804 140
MYL Float 05/20	800 000	99.99%	EUR	99.99%	145	800 033
PHIANA Float 09/2019	750 000	100.39%	EUR	100.39%		752 903
SYDBDC Float 05/18	500 000	100.21%	EUR	100.21%	123	501 178
NYKRE Float 06/22	1 000 000	100.29%	EUR	100.29%	181	1 003 051
KBCBB Float 11/22	500 000	100.76%	EUR	100.76%	117	503 897
GE 2.875% 06/2019	1 000 000	105.16%	EUR	105.16%	8 271	1 059 911
GE 2.25% 07/2020	2 000 000	106.34%	EUR	106.34%	9 000	2 135 860
DLTAS 2008-1 A	1 139 762	99.40%	EUR	99.40%	50	1 132 996
DHR Float 06/22	700 000	100.27%	EUR	100.27%		701 883
DE Float 09/20	1 000 000	100.47%	EUR	100.47%		1 004 650
SUMIBK Float 06/22	500 000	100.55%	EUR	100.55%	28	502 788
BMO Float 09/21	750 000	101.27%	EUR	101.27%	11	759 566
AMXLMM 4.125%10/2019	700 000	108.43%	EUR	108.43%	26 976	786 014
AMXLMM 1% 06/2018	2 500 000	100.64%	EUR	100.64%	8 151	2 524 201
CAFP FLT 03/18	700 000	100.27%	EUR	100.27%	85	701 940
GLENLN 2.625% 11/18	800 000	102.81%	EUR	102.81%	18 181	840 693
BACR Float 03/2021	900 000	92.25%	EUR	92.25%	32	830 282
CCBGBB Float 03/18	500 000	100.05%	EUR	100.05%	24	500 294
GSFloat 10/2019	50 000	101.06%	EUR	101.06%	36	50 566
GS Float 09/2018	500 000	100.49%	EUR	100.49%	89	502 524
BAC Float 05/2019	700 000	101.73%	EUR	101.73%	1 232	713 314
C Float 11/2019	100 000	100.85%	EUR	100.85%	31	100 880
ANNGR Float 09/18	500 000	100.13%	EUR	100.13%	12	500 637
UNANA Float 06/18	500 000	100.15%	EUR	100.15%		500 765
SOCGEN Float 02/18	200 000	100.14%	EUR	100.14%	5	200 279

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2017-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BSN Float 09/2018	500 000	100.34%	EUR	100.34%	14	501 704
BATSLN Float 03/2018	500 000	100.15%	EUR	100.15%	59	500 804
RY Float 03/2019	300 000	100.61%	EUR	100.61%	4	301 843
RY Float 10/2018	500 000	100.43%	EUR	100.43%	94	502 259
DAIGR Float 01/2019	200 000	100.43%	EUR	100.43%	90	200 946
DAIGR Float 03/18	100 000	100.15%	EUR	100.15%	8	100 158
VOD Float 02/2019	200 000	101.21%	EUR	101.21%	128	202 544
RENAUL Float 03/19	600 000	101.10%	EUR	101.10%	145	606 727
NAB Float 01/18	500 000	100.10%	EUR	100.10%		500 500
NDASS Float 02/19	200 000	100.59%	EUR	100.59%	27	201 203
ENELIM Float 02/2018	500 000	101.16%	EUR	101.16%	1 611	507 411
ENIIMFloat 10/2017	400 000	100.06%	EUR	100.06%	4 919	405 163
CAT Float 05/2018	200 000	100.10%	EUR	100.10%		200 194
JYBC Float 03/2018	400 000	100.14%	EUR	100.14%	1	400 561
UCGIM Float 12/2017	650 000	100.36%	EUR	100.36%	362	652 709
UCGIM Float 02/2020	650 000	101.79%	EUR	101.79%	497	662 138
UCGIM Float 10/2017	500 000	100.12%	EUR	100.12%	1 416	502 026
MAERSK Float 03/19	200 000	102.00%	EUR	102.00%	92	204 098
HON Float 02/18	100 000	100.14%	EUR	100.14%	19	100 163
COVEGR Float 03/18	200 000	100.16%	EUR	100.16%	30	200 342
ALDINT Float 11/2017	200 000	100.07%	EUR	100.07%	48	200 193
FDX Float 04/19	300 000	100.41%	EUR	100.41%	150	301 383
CAPFP Float 07/2018	700 000	100.33%	EUR	100.33%	908	703 204
VW Float 07/2018	100 000	100.07%	EUR	100.07%		100 073
F Float 02/2018	500 000	100.09%	EUR	100.09%	103	500 543
BPCEGP Float 05/2018	500 000	100.42%	EUR	100.42%	156	502 241
ISPIM Float 04/2019	600 000	101.33%	EUR	101.33%	911	608 885
ISPIM Float 06/20	200 000	102.09%	EUR	102.09%	64	204 242
INTNED Float 02/18	200 000	100.20%	EUR	100.20%	39	200 431
NWIDE Float 11/2018	700 000	100.51%	EUR	100.51%	198	703 796
BMW Float 04/2018	700 000	100.12%	EUR	100.12%		700 826
SWEDA FLOAT 03/19	200 000	101.02%	EUR	101.02%	47	202 081
						161 974 379
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					50 063	7 157 515
Obrigações diversas						
HUWY 1.375% 10/2021	2 000 000	103.74%	EUR	103.74%	25 240	2 100 020
K 1.75% 05/2021	1 000 000	105.14%	EUR	105.14%	6 233	1 057 653
KO Float 03/19	300 000	100.41%	EUR	100.41%		301 224
UBS Float 09/22	1 000 000	101.34%	EUR	101.34%	113	1 013 473
AGN Float 06/19	1 000 000	100.09%	EUR	100.09%	17	1 000 957
WESAU 1.25% 10/2021	1 500 000	104.34%	EUR	104.34%	18 442	1 583 467
AT&T Float 06/19	100 000	100.70%	EUR	100.70%	18	100 721
						7 157 515
						185 871 613

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 2017-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
OIC domiciliados em Portugal						36 910 071
CXG OBRIGAÇÕES	2 258 307	4.48	EUR	4.48		10 116 987
CXG LIQUIDEZ	5 021 569	5.34	EUR	5.34		26 793 084
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						31 964 405
AXA WF EU CREDIT	182 555	136.54	EUR	136.54		24 926 060
Natixis Tresorie I	561	12 546.07	EUR	12 546.07		7 038 345
						68 874 476

LIQUIDEZ

À vista						9 108 295
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			9 108 295

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						13 500
Valores Passivos						-214 145
						-200 645
						263 653 738

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO	44 652 811.41
--------------------------------------------------	---------------

Valor da Unidade de Participação: € 5.9045