

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2018-09-30

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.					6 187	2 196 797
Obrigações diversas						
TAGST 09-ENGY A1/25	706 964	101.50%	EUR	101.50%	589	718 157
CXGD 1% 01/2022	700 000	101.95%	EUR	101.95%	4 737	718 401
VERSE 3 SNR 02/2019	449 697	100.19%	EUR	100.19%	472	451 038
VERSE 4 SNR 02/2021	303 457	101.76%	EUR	101.76%	388	309 201
						2 196 797
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					789 549	108 919 147
Títulos de Dívida Pública						
BOTS 0% 09/2019	2 500 000	99.30%	EUR	99.30%	508	2 482 915
FADE 0.031% 06/2020	5 400 000	100.12%	EUR	100.12%	486	5 406 912
						7 889 827
Obrigações diversas						
NOSPL 1.125% 05/23	2 500 000	99.82%	EUR	99.82%	11 712	2 507 262
DAIGR Float 07/24	1 000 000	99.55%	EUR	99.55%	323	995 853
BASGR Float 11/19	1 300 000	100.27%	EUR	100.27%		1 303 562
SAPGR Float 03/21	1 100 000	100.43%	EUR	100.43%		1 104 741
COFP 4.481% 11/2018	6 000 000	100.13%	EUR	100.13%	304 293	6 312 093
RENAUL 1.125% 09/19	1 200 000	101.15%	EUR	101.15%	37	1 213 825
MCFP 1% 09/2021	1 400 000	102.46%	EUR	102.46%	268	1 434 750
RENAULT Float 08/20	100 000	100.20%	EUR	100.20%	30	100 233
BPCEGP Float 03/22	500 000	101.30%	EUR	101.30%	213	506 693
RENAULT Float 04/21	100 000	100.47%	EUR	100.47%	74	100 546
ACAFP Float 04/22	1 000 000	100.51%	EUR	100.51%	971	1 006 031
MCFP 0% 05/20	4 300 000	100.03%	EUR	100.03%		4 301 204
BNP Float 06/24	800 000	99.94%	EUR	99.94%	230	799 742
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.15%	EUR	100.15%	66	400 666
GFCFP Float 06/22	800 000	99.78%	EUR	99.78%	4	798 252
ALDFP Float 11/20	500 000	100.02%	EUR	100.02%	54	500 154
SANFP Float 03/20	900 000	100.34%	EUR	100.34%		903 069
BNP Float 05/23	500 000	99.56%	EUR	99.56%	167	497 982
HSBC 0.2% 09/21	2 000 000	99.95%	EUR	99.95%	296	1 999 236
ABBEY 2.625% 07/2020	750 000	104.55%	EUR	104.55%	4 153	788 286
ABBEY 0.875% 01/2020	500 000	101.11%	EUR	101.11%	3 128	508 693
LLOYDS 0.625% 04/20	1 500 000	101.04%	EUR	101.04%	4 212	1 519 812
HSBC Float 09/22	750 000	100.51%	EUR	100.51%	32	753 857
F Float 08/20	300 000	99.71%	EUR	99.71%	51	299 181
WPPLN Float 05/20	800 000	100.06%	EUR	100.06%	1	800 473
SANUK Float 05/23	500 000	99.36%	EUR	99.36%	269	497 049
RBS Float 06/20	900 000	99.86%	EUR	99.86%	58	898 771
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	99.49%	EUR	99.49%	128	995 068
HSBC 0.17% 10/23	500 000	99.65%	EUR	99.65%	219	498 464
RBS Float 03/2020	100 000	99.86%	EUR	99.86%	6	99 862

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
GSK Float 05/20	500 000	100.31%	EUR	100.31%		501 560
RBS Float 09/21	1 400 000	100.18%	EUR	100.18%	90	1 402 624
TELEFO 4.693% 11/19	1 000 000	105.19%	EUR	105.19%	41 658	1 093 588
REDELE 4.875% 04/202	1 000 000	107.68%	EUR	107.68%	20 702	1 097 482
IBESM Float 02/24	1 100 000	100.85%	EUR	100.85%	450	1 109 811
SANTAN Float 03/22	600 000	101.07%	EUR	101.07%	117	606 519
CRUNAV Float 06/2022	500 000	99.75%	EUR	99.75%	46	498 771
AMSSM Float 03/22	600 000	100.24%	EUR	100.24%	28	601 468
VLVY 2.375% 11/26/19	250 000	102.73%	EUR	102.73%	5 027	261 847
SCANIA Float 04/20	500 000	100.18%	EUR	100.18%	80	501 000
ENIIM 4.25% 02/20	700 000	105.66%	EUR	105.66%	19 562	759 182
ISPIM 1.125% 01/2020	1 600 000	100.32%	EUR	100.32%	12 822	1 617 990
ISPIM 4.125% 04/2020	750 000	104.85%	EUR	104.85%	14 409	800 784
ISPIM 2% 06/2021	1 000 000	101.58%	EUR	101.58%	5 753	1 021 523
ISPIM Float 04/22	450 000	97.39%	EUR	97.39%	582	438 850
GS 5.125% 10/2019	1 200 000	105.50%	EUR	105.50%	57 793	1 323 793
BAC 2.5% 07/2020	750 000	104.57%	EUR	104.57%	3 390	787 688
MS Float 01/22	500 000	100.37%	EUR	100.37%	347	502 212
MS Float 03/12/2019	200 000	100.06%	EUR	100.06%	27	200 147
BAC Float 02/22	200 000	100.79%	EUR	100.79%	147	201 729
BAC Float 05/23	400 000	100.57%	EUR	100.57%	287	402 563
GM Float 05/21	1 800 000	100.27%	EUR	100.27%	939	1 805 835
BATSLN Float 08/21	500 000	100.04%	EUR	100.04%	116	500 316
BAC Float 09/21	500 000	99.96%	EUR	99.96%	7	499 822
GS Float 09/23	1 100 000	99.28%	EUR	99.28%	46	1 092 071
UTX Float 11/19	1 500 000	100.14%	EUR	100.14%		1 502 085
T Float 09/2023	1 500 000	101.20%	EUR	101.20%	597	1 518 582
MS Float 05/21	500 000	100.01%	EUR	100.01%	46	500 096
CS 1.375% 11/2019	1 200 000	101.76%	EUR	101.76%	13 833	1 234 917
UBS Float 04/2021	200 000	100.52%	EUR	100.52%	70	201 102
SCANIA Float 03/21	1 100 000	99.85%	EUR	99.85%	56	1 098 391
ENELIM 4.875% 03/20	1 250 000	106.93%	EUR	106.93%	34 058	1 370 621
REPSM 2.625% 05/2020	2 500 000	104.24%	EUR	104.24%	22 654	2 628 654
IBESM 2.875% 11/2020	1 000 000	105.96%	EUR	105.96%	25 521	1 085 161
RENEPL 4.75% 10/2020	1 000 000	108.98%	EUR	108.98%	45 548	1 135 368
ACHMEA 2.5% 11/2020	2 800 000	104.86%	EUR	104.86%	60 603	2 996 739
NOMURA 1.125% 06/20	1 000 000	101.83%	EUR	101.83%	3 699	1 022 039
MYL FLOAT 11/18	1 200 000	100.09%	EUR	100.09%	735	1 201 827
BMW 0.125% 07/20	3 000 000	100.30%	EUR	100.30%	925	3 009 805
LPTY Float 11/20	800 000	100.35%	EUR	100.35%	250	803 058
MYL Float 05/20	800 000	100.12%	EUR	100.12%	153	801 081
AKZANA Float 11/19	900 000	100.21%	EUR	100.21%		901 917
ANNGR FLOAT 11/19	500 000	100.15%	EUR	100.15%	18	500 788
ALVGR Float 12/20	300 000	100.93%	EUR	100.93%	36	302 817
LPTY Float 01/21	200 000	100.28%	EUR	100.28%	68	200 634
ADNA Float 03/21	200 000	100.05%	EUR	100.05%		200 108
DAIGR Float 04/20	300 000	100.41%	EUR	100.41%	125	301 364

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
TOYOTA FLT 04/27	500 000	100.11%	EUR	100.11%	27	500 592
BAYNGR 0.625% 12/22	100 000	100.46%	EUR	100.46%	166	100 623
BAYNGR Float 06/22	300 000	100.33%	EUR	100.33%	10	301 012
ABNANV 0.5% 07/2023	2 000 000	99.45%	EUR	99.45%	2 082	1 991 082
NIBCAP Float 07/20	900 000	100.13%	EUR	100.13%	284	901 418
NYKRE Float 06/22	1 000 000	99.90%	EUR	99.90%	195	999 185
JYBC Float 06/20	1 000 000	100.32%	EUR	100.32%	24	1 003 194
MINGNO 0.75% 03/23	2 000 000	99.29%	EUR	99.29%	3 699	1 989 559
SPOLENO Float 09/21	1 900 000	100.01%	EUR	100.01%	42	1 900 223
CBSBKF Float 03/21	600 000	100.25%	EUR	100.25%	63	601 557
KBCBB Float 11/22	500 000	99.91%	EUR	99.91%	122	499 657
GE 2.25% 07/2020	2 000 000	104.03%	EUR	104.03%	9 000	2 089 660
DLTAS 2008-1 A	944 527	99.50%	EUR	99.50%	33	939 884
DHR Float 06/22	700 000	99.99%	EUR	99.99%		699 895
DE Float 09/20	1 000 000	100.21%	EUR	100.21%		1 002 110
SUMIBK Float 06/22	500 000	99.94%	EUR	99.94%	31	499 736
BNS FLOAT 10/22	1 000 000	101.06%	EUR	101.06%	682	1 011 262
BCHINA Float 11/20	300 000	99.85%	EUR	99.85%	50	299 594
AMXLMM 4.125%10/2019	700 000	104.27%	EUR	104.27%	26 976	756 838
GLENLN 2.625% 11/18	800 000	100.29%	EUR	100.29%	18 181	820 525
BACR Float 03/2021	900 000	96.61%	EUR	96.61%	26	869 489
GSFloat 10/2019	50 000	100.57%	EUR	100.57%	38	50 322
BAC Float 05/2019	700 000	100.60%	EUR	100.60%	1 242	705 407
C Float 11/2019	100 000	100.44%	EUR	100.44%	31	100 471
RY Float 03/2019	300 000	100.19%	EUR	100.19%	4	300 577
RY Float 10/2018	500 000	100.03%	EUR	100.03%	106	500 231
ISPIM Float 04/2019	600 000	100.16%	EUR	100.16%	923	601 907
ISPIM Float 06/20	200 000	100.02%	EUR	100.02%	57	200 089
SWEDA FLOAT 08/2020	200 000	100.72%	EUR	100.72%	42	201 478
						101 029 320
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					50 102	6 896 749
Obrigações diversas						
HUWY 1.375% 10/2021	2 000 000	102.67%	EUR	102.67%	25 240	2 078 580
K 1.75% 05/2021	1 000 000	103.82%	EUR	103.82%	6 233	1 044 463
F Float 05/21	300 000	98.99%	EUR	98.99%	44	296 999
UBS Float 09/22	1 000 000	100.47%	EUR	100.47%	116	1 004 766
SUMIBK Float 09/20	900 000	100.58%	EUR	100.58%	27	905 229
WESAU 1.25% 10/2021	1 500 000	103.22%	EUR	103.22%	18 442	1 566 712
						6 896 749
						118 012 694
OUTROS VALORES						
Outros Instrumentos de Dívida					1 714	7 701 714
Papel Comercial						
PC P.COM.C.AMORIM 11ªEM 0.0800% 2018-09-28 a 2018-10-31			EUR		20	3 000 020
PC P.C.S.CAETANO 9ª EM. 2.9000% 2018-09-21 a 2018-12-20			EUR		685	850 685

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2018-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
PC P.COM.SONAE 882ª EM. 0.1500% 2018-08-30 a 2018-10-15			EUR		267	2 000 267
PC P.COM.J.MELLO 36ªEM. 0.8500% 2018-09-14 a 2018-10-15			EUR		743	1 850 743
						7 701 714
						7 701 714

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						32 562 851
CXG OBRIGAÇÕES	2 258 307	4.45	EUR	4.45		10 050 367
CXG LIQUIDEZ	4 224 285	5.33	EUR	5.33		22 512 484
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						24 792 797
AXA WF EUR SD-I-XC€	248 649	99.71	EUR	99.71		24 792 797
						57 355 648

LIQUIDEZ

À vista						1 310 300
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			1 022 915
DO EUR-RBS (GR+ 0.0000%			EUR			277 384
DO SANTANDER - 0.0000%			EUR			5 000
DO BCP - EUR 0.0000%			EUR			5 000
						1 310 300
A prazo					20 905	42 020 905
Depósitos com pré aviso e a prazo						
DP DP BCP 05JUN 365D 0.1200% 2018-06-05 a 2019-06-05			EUR		5 900	15 005 900
DP DP BCP 12JUL 365D 0.1800% 2018-07-12 a 2019-07-12			EUR		2 025	5 002 025
DP DP SANTANDER 05JUN 0.1800% 2018-06-05 a 2019-06-05			EUR		12 980	22 012 980
						42 020 905
						43 331 205

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						113 016
Valores Passivos						-208 443
						-95 427
						226 305 834

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

Em mercado regulamentado

Futuros

OEZ8 EUR EUX 12/18	-90	130.72	EUR	130.72		-11 764 800
--------------------	-----	--------	-----	--------	--	-------------

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

38 482 524.68

Valor da Unidade de Participação: € 5.8807