

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA  
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE  
 Composição da Carteira em 2018-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
<b>COMPOSIÇÃO DISCRIMINADA CARTEIRA</b>						
<b>VALORES MOBILIÁRIOS COTADOS</b>						
Merc. Cot. Oficiais de Bolsa Val. Port.					7 141	3 486 426
Obrigações diversas						
CXGD 3% 01/2019	600 000	102.48%	EUR	102.48%	3 748	618 598
TAGST 09-ENGY A1/25	759 222	102.85%	EUR	102.85%	666	781 526
CXGD 1% 01/2022	700 000	102.26%	EUR	102.26%	1 227	717 075
VERSE 3 SNR 02/2019	984 439	100.83%	EUR	100.83%	1 034	993 693
VERSE 4 SNR 02/2021	364 056	103.03%	EUR	103.03%	466	375 534
						3 486 426
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					1 363 901	155 613 520
Titulos de Dívida Pública						
FADE 0.031% 06/2020	5 400 000	100.48%	EUR	100.48%	1 325	5 427 461
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	1 000 000	100.15%	EUR	100.15%	296	1 001 836
VW Float 07/19	1 100 000	100.19%	EUR	100.19%	53	1 102 121
BASGR Float 11/19	1 300 000	100.45%	EUR	100.45%		1 305 811
SAPGR Float 03/21	1 100 000	100.64%	EUR	100.64%		1 107 073
COFP 4.481% 11/2018	6 000 000	103.14%	EUR	103.14%	131 892	6 320 352
LGFP 5.375% 11/2018	5 000 000	103.50%	EUR	103.50%	90 565	5 265 365
MWDP 6.75% 04/2018	4 000 000	100.29%	EUR	100.29%	255 945	4 267 425
COFP 5.244% 03/2020	1 000 000	107.76%	EUR	107.76%	3 304	1 080 924
PPFP 3.125% 04/2019	1 200 000	103.42%	EUR	103.42%	35 240	1 276 292
RENAUL 1.125% 09/19	1 200 000	101.63%	EUR	101.63%	6 768	1 226 376
MCFP 1% 09/2021	1 400 000	102.80%	EUR	102.80%	7 249	1 446 505
BPCEGP 5.1% 06/2018	1 480 000	101.20%	EUR	101.20%	1 026	1 498 763
RENAUL 3.625% 09/18	2 000 000	101.66%	EUR	101.66%	38 534	2 071 754
KERFP 1.875% 10/2018	1 500 000	101.05%	EUR	101.05%	13 485	1 529 265
BPCEGP 3.7% 05/2018	2 530 000	100.42%	EUR	100.42%	12 096	2 552 734
BNFP Float 11/18	400 000	100.14%	EUR	100.14%		400 572
RENAULT Float 08/20	100 000	100.43%	EUR	100.43%	28	100 453
BPCEGP Float 03/22	500 000	102.28%	EUR	102.28%	231	511 641
RENAULT Float 04/21	100 000	100.79%	EUR	100.79%	70	100 864
ACAFP Float 04/22	1 000 000	101.35%	EUR	101.35%	905	1 014 435
MCFP 0% 05/20	4 300 000	100.02%	EUR	100.02%		4 300 946
MCFP Float 11/18	465 000	100.19%	EUR	100.19%		465 860
BNP Float 06/24	800 000	100.88%	EUR	100.88%	235	807 275
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.88%	EUR	100.88%	69	403 593
GFCFP Float 06/22	800 000	100.12%	EUR	100.12%	3	800 987
ALDFP Float 11/20	500 000	100.33%	EUR	100.33%	47	501 687
SANFP Float 03/20	900 000	100.55%	EUR	100.55%		904 959
ABBEY 2.625% 07/2020	750 000	105.71%	EUR	105.71%	13 970	806 773
LLOYDS 1.875% 10/18	1 500 000	101.11%	EUR	101.11%	13 330	1 529 995
ABBEY 2% 01/2019	1 000 000	101.73%	EUR	101.73%	4 219	1 021 549
DGELN 1.125% 05/2019	1 000 000	101.29%	EUR	101.29%	9 740	1 022 630

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
F 1.75% 05/18	5 000 000	100.24%	EUR	100.24%	75 514	5 087 664
ABBEY 0.875% 01/2020	500 000	101.51%	EUR	101.51%	935	508 480
LLOYDS 0.625% 04/20	1 500 000	101.31%	EUR	101.31%	8 887	1 528 462
HSBC Float 09/22	750 000	100.94%	EUR	100.94%	39	757 081
F Float 08/20	300 000	100.51%	EUR	100.51%	49	301 564
WPPLN Float 05/20	800 000	100.20%	EUR	100.20%		801 616
SANUK Float 05/23	500 000	100.35%	EUR	100.35%	257	501 987
RBS Float 06/20	900 000	100.34%	EUR	100.34%	62	903 104
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	100.24%	EUR	100.24%	138	1 002 488
HSBC 0.17% 10/23	500 000	99.94%	EUR	99.94%	204	499 914
RBS Float 03/2020	100 000	100.24%	EUR	100.24%	6	100 241
TELEFO 4.693% 11/19	1 000 000	107.57%	EUR	107.57%	18 129	1 093 859
REDELE 4.875% 04/2022	1 000 000	110.19%	EUR	110.19%	45 010	1 146 870
CABKSM 3.125% 05/18	4 000 000	100.36%	EUR	100.36%	110 274	4 124 794
SANTAN 1.1% 07/2018	2 000 000	100.42%	EUR	100.42%	14 827	2 023 267
SANSCF Float 01/19	600 000	100.24%	EUR	100.24%	161	601 601
IBESM Float 02/24	1 100 000	100.90%	EUR	100.90%	418	1 110 351
SANTAN Float 03/22	600 000	101.95%	EUR	101.95%	127	611 797
BBVASM Float 04/22	1 200 000	101.16%	EUR	101.16%	714	1 214 598
CRUNAV Float 06/2022	500 000	99.34%	EUR	99.34%	49	496 744
VLVY 2.375% 11/26/19	250 000	103.93%	EUR	103.93%	2 050	261 870
SCANIA Float 10/18	500 000	100.14%	EUR	100.14%	20	500 695
SCANIA Float 04/20	500 000	100.36%	EUR	100.36%	69	501 849
ENIIM 4.25% 02/20	700 000	107.77%	EUR	107.77%	4 646	759 050
ISPIM 1.125% 01/2020	1 600 000	101.86%	EUR	101.86%	3 797	1 633 477
ISPIM 4.125% 04/2020	750 000	108.07%	EUR	108.07%	29 836	840 376
UCGIM 5% 05/2018	475 000	100.68%	EUR	100.68%	20 497	498 717
UCGIM 5.65% 08/2018	1 000 000	102.23%	EUR	102.23%	34 055	1 056 340
ISPIM 2% 06/2021	1 000 000	104.98%	EUR	104.98%	15 726	1 065 536
ISPIM Float 04/22	450 000	101.73%	EUR	101.73%	560	458 327
GS 5.125% 10/2019	1 200 000	107.95%	EUR	107.95%	26 959	1 322 299
BAC 2.5% 07/2020	750 000	105.51%	EUR	105.51%	12 740	804 042
JPM Float 06/2018	650 000	100.06%	EUR	100.06%		650 377
MS Float 01/22	500 000	100.71%	EUR	100.71%	321	503 861
MS Float 03/12/2019	200 000	100.22%	EUR	100.22%	26	200 466
BAC Float 02/22	200 000	101.01%	EUR	101.01%	139	202 163
BAC Float 05/23	400 000	100.85%	EUR	100.85%	276	403 688
GM Float 05/21	1 800 000	100.65%	EUR	100.65%	842	1 812 596
TMO Float 07/2019	1 500 000	100.17%	EUR	100.17%		1 502 580
BATSLN Float 08/21	500 000	100.31%	EUR	100.31%	105	501 660
BAC Float 09/21	500 000	99.97%	EUR	99.97%	6	499 836
GS Float 09/23	1 100 000	99.67%	EUR	99.67%	53	1 096 412
UTX Float 11/19	1 500 000	100.38%	EUR	100.38%		1 505 655
T Float 09/2023	1 500 000	102.27%	EUR	102.27%	588	1 534 608
CS 1.375% 11/2019	1 200 000	102.31%	EUR	102.31%	5 560	1 233 232
UBS Float 09/2019	400 000	100.58%	EUR	100.58%	52	402 380
REPSM 4.875% 02/2019	2 500 000	104.38%	EUR	104.38%	13 690	2 623 215

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
IBESM 4.25% 10/2018	1 200 000	102.30%	EUR	102.30%	24 033	1 251 573
ENELIM 4.875% 03/20	1 250 000	109.42%	EUR	109.42%	3 506	1 371 206
REPSM 2.625% 05/2020	2 500 000	105.54%	EUR	105.54%	55 377	2 693 777
IBESM 2.875% 11/2020	1 000 000	107.26%	EUR	107.26%	11 106	1 083 736
RENEPL 4.75% 10/2020	1 000 000	111.82%	EUR	111.82%	21 733	1 139 943
ACHMEA 2.5% 11/2020	2 800 000	106.11%	EUR	106.11%	25 507	2 996 699
NOMURA 1.125% 06/20	1 000 000	102.01%	EUR	102.01%	9 308	1 029 428
ACHMEA 0.875% 09/18	4 000 000	100.50%	EUR	100.50%	18 795	4 038 835
ABNANV Float 01/19	600 000	100.36%	EUR	100.36%	217	602 371
MYL FLOAT 11/18	1 200 000	100.36%	EUR	100.36%	685	1 204 993
VW 0.5% 03/21	600 000	100.61%	EUR	100.61%	16	603 676
VW Float 03/19	600 000	100.16%	EUR	100.16%	1	600 973
BMW 0.125% 07/20	3 000 000	100.31%	EUR	100.31%	2 795	3 011 975
LPTY Float 11/20	800 000	100.44%	EUR	100.44%	235	803 787
MYL Float 05/20	800 000	100.16%	EUR	100.16%	138	801 450
PHIANA Float 09/2019	750 000	100.36%	EUR	100.36%		752 670
AKZANA Float 11/19	900 000	100.35%	EUR	100.35%		903 123
ANNGR FLOAT 11/19	500 000	100.27%	EUR	100.27%	12	501 352
ALVGR Float 12/20	300 000	101.16%	EUR	101.16%	36	303 504
LPTY Float 01/21	200 000	100.43%	EUR	100.43%	63	200 925
ADNA Float 03/21	200 000	100.31%	EUR	100.31%		200 622
NYKRE Float 06/22	1 000 000	100.61%	EUR	100.61%	203	1 006 313
JYBC Float 06/20	1 000 000	100.41%	EUR	100.41%	19	1 004 099
CBSBKF Float 03/21	600 000	100.40%	EUR	100.40%	69	602 493
KBCBB Float 11/22	500 000	100.77%	EUR	100.77%	105	503 935
GE 2.875% 06/2019	1 000 000	103.52%	EUR	103.52%	22 606	1 057 816
GE 2.25% 07/2020	2 000 000	104.81%	EUR	104.81%	31 438	2 127 598
DLTAS 2008-1 A	1 042 265	100.00%	EUR	100.00%	52	1 042 317
DHR Float 06/22	700 000	100.39%	EUR	100.39%		702 702
DE Float 09/20	1 000 000	100.41%	EUR	100.41%		1 004 120
SUMIBK Float 06/22	500 000	100.35%	EUR	100.35%	31	501 796
BMO Float 09/21	750 000	100.88%	EUR	100.88%	14	756 644
BNS FLOAT 10/22	1 000 000	101.47%	EUR	101.47%	647	1 015 327
ICBCAS FLOAT 10/20	1 000 000	100.18%	EUR	100.18%	485	1 002 315
BCHINA Float 11/20	300 000	99.96%	EUR	99.96%	45	299 934
AMXLMM 4.125%10/2019	700 000	106.43%	EUR	106.43%	12 499	757 488
AMXLMM 1% 06/2018	2 500 000	100.08%	EUR	100.08%	20 616	2 522 716
GLENLN 2.625% 11/18	800 000	101.61%	EUR	101.61%	7 652	820 532
BACR Float 03/2021	900 000	96.80%	EUR	96.80%	35	871 262
GSFloat 10/2019	50 000	100.81%	EUR	100.81%	36	50 443
GS Float 09/2018	500 000	100.23%	EUR	100.23%	90	501 260
BAC Float 05/2019	700 000	101.15%	EUR	101.15%	1 188	709 238
C Float 11/2019	100 000	100.70%	EUR	100.70%	29	100 729
ANNGR Float 09/18	500 000	100.09%	EUR	100.09%	14	500 474
UNANA Float 06/18	500 000	100.04%	EUR	100.04%		500 200
BSN Float 09/2018	500 000	100.16%	EUR	100.16%	15	500 815
RY Float 03/2019	300 000	100.40%	EUR	100.40%	5	301 193

## CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
RY Float 10/2018	500 000	100.23%	EUR	100.23%	98	501 233
DAIGR Float 01/2019	200 000	100.34%	EUR	100.34%	88	200 764
VOD Float 02/2019	200 000	100.78%	EUR	100.78%	117	201 681
RENAUL Float 03/19	600 000	100.84%	EUR	100.84%	146	605 156
NDASS Float 02/19	200 000	100.37%	EUR	100.37%	26	200 774
CAT Float 05/2018	200 000	100.02%	EUR	100.02%		200 044
UCGIM Float 02/2020	650 000	101.38%	EUR	101.38%	497	659 467
FDX Float 04/19	300 000	100.34%	EUR	100.34%	147	301 176
CAPFP Float 07/2018	700 000	100.05%	EUR	100.05%	902	701 238
VW Float 07/2018	100 000	100.05%	EUR	100.05%		100 049
BPCEGP Float 05/2018	500 000	100.10%	EUR	100.10%	148	500 648
ISPIM Float 04/2019	600 000	100.84%	EUR	100.84%	889	605 923
ISPIM Float 06/20	200 000	101.63%	EUR	101.63%	68	203 320
NWIDE Float 11/2018	700 000	100.28%	EUR	100.28%	194	702 133
BMW Float 04/2018	700 000	100.01%	EUR	100.01%		700 070
SWEDA FLOAT 08/2020	200 000	101.00%	EUR	101.00%	39	202 033
SWEDA FLOAT 03/19	200 000	100.66%	EUR	100.66%	47	201 365
						150 186 058
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					35 614	7 115 694
Obrigações diversas						
HUWY 1.375% 10/2021	2 000 000	103.44%	EUR	103.44%	11 452	2 080 192
K 1.75% 05/2021	1 000 000	104.31%	EUR	104.31%	14 959	1 058 089
KO Float 03/19	300 000	100.28%	EUR	100.28%		300 843
UBS Float 09/22	1 000 000	101.03%	EUR	101.03%	124	1 010 404
AGN Float 06/19	1 000 000	100.14%	EUR	100.14%	19	1 001 409
WESAU 1.25% 10/2021	1 500 000	103.68%	EUR	103.68%	9 041	1 564 181
AT&T Float 06/19	100 000	100.56%	EUR	100.56%	19	100 576
						7 115 694
						166 215 640
<b>UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)</b>						
OIC domiciliados em Portugal						36 905 337
CXG OBRIGAÇÕES	2 258 307	4.47	EUR	4.47		10 098 695
CXG LIQUIDEZ	5 021 569	5.34	EUR	5.34		26 806 642
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						24 897 229
AXA WF EUR SD-I-XC€	248 649	100.13	EUR	100.13		24 897 229
						61 802 566
<b>LIQUIDEZ</b>						
À vista						19 021 513
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			19 021 513
<b>OUTROS VALORES A REGULARIZAR</b>						
Valores Activos						3 000
Valores Passivos						-186 558

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA  
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE  
Composição da Carteira em 2018-03-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
						-183 558
						246 856 160

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO  
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

41 849 073.96

Valor da Unidade de Participação: € 5.8987