

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA  
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE  
 Composição da Carteira em 2018-02-28

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.					174 346	9 224 158
Títulos de Dívida Pública						
OT 4.8% 06/2020	1 250 000	111.04%	EUR	111.04%	42 575	1 430 525
OT 3.85% 04/2021	1 750 000	111.50%	EUR	111.50%	59 068	2 010 388
OT 4.75% 06/2019	2 000 000	106.45%	EUR	106.45%	67 671	2 196 671
						5 637 585
Obrigações diversas						
CXGD 3% 01/2019	600 000	102.78%	EUR	102.78%	2 219	618 869
TAGST 09-ENGY A1/25	767 932	102.15%	EUR	102.15%	573	785 015
CXGD 1% 01/2022	700 000	101.76%	EUR	101.76%	633	712 925
VERSE 3 SNR 02/2019	1 073 047	100.90%	EUR	100.90%	1 127	1 083 885
VERSE 4 SNR 02/2021	374 084	103.03%	EUR	103.03%	478	385 879
						3 586 573
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					1 345 697	158 496 278
Títulos de Dívida Pública						
FADE 0.031% 06/2020	5 400 000	100.08%	EUR	100.08%	1 183	5 405 341
Obrigações diversas						
DAIGR Float 07/24	1 000 000	100.88%	EUR	100.88%	192	1 009 012
VW Float 07/19	1 100 000	100.26%	EUR	100.26%	33	1 102 871
BASGR Float 11/19	1 300 000	100.48%	EUR	100.48%		1 306 253
COFP 4.481% 11/2018	6 000 000	103.86%	EUR	103.86%	102 687	6 333 987
LGFP 5.375% 11/2018	5 000 000	104.05%	EUR	104.05%	67 740	5 270 190
MWDP 6.75% 04/2018	4 000 000	100.90%	EUR	100.90%	233 014	4 269 014
COFP 3.994 03/2020	1 000 000	109.24%	EUR	109.24%	39 065	1 131 455
PPFP 3.125% 04/2019	1 200 000	103.74%	EUR	103.74%	32 055	1 276 947
RENAUL 1.125% 09/19	1 200 000	101.76%	EUR	101.76%	5 622	1 226 682
MCFP 1% 09/2021	1 400 000	102.96%	EUR	102.96%	6 060	1 447 500
BPCEGP 5.1% 06/2018	1 480 000	101.70%	EUR	101.70%	13 419	1 518 645
RENAUL 3.625% 09/18	2 000 000	102.06%	EUR	102.06%	32 377	2 073 557
KERFP 1.875% 10/2018	1 500 000	101.25%	EUR	101.25%	11 096	1 529 876
BPCEGP 3.7% 05/2018	2 530 000	100.77%	EUR	100.77%	3 944	2 553 425
BNFP Float 11/18	400 000	100.19%	EUR	100.19%		400 744
RENAULT Float 08/20	100 000	100.58%	EUR	100.58%	17	100 597
BPCEGP Float 03/22	500 000	102.86%	EUR	102.86%	806	515 081
RENAULT Float 04/21	100 000	101.03%	EUR	101.03%	43	101 073
ACAFP Float 04/22	1 000 000	101.87%	EUR	101.87%	498	1 019 228
MCFP 0% 05/20	4 300 000	100.11%	EUR	100.11%		4 304 644
MCFP Float 11/18	465 000	100.22%	EUR	100.22%		466 000
BNP Float 06/24	800 000	101.80%	EUR	101.80%	791	815 167
RENAUL Float 03/2022	400 000	101.40%	EUR	101.40%	293	405 885
GFCFP Float 06/22	800 000	100.35%	EUR	100.35%	70	802 886
ALDFP Float 11/20	500 000	100.43%	EUR	100.43%	3	502 148
ABBAY 2.625% 07/2020	750 000	106.10%	EUR	106.10%	12 298	808 033

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-02-28

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
LLOYDS 1.875% 10/18	1 500 000	101.27%	EUR	101.27%	10 942	1 530 022
ABBEY 2% 01/2019	1 000 000	101.97%	EUR	101.97%	2 521	1 022 171
DGELN 1.125% 05/2019	1 000 000	101.44%	EUR	101.44%	8 784	1 023 184
F 1.75% 05/18	5 000 000	100.41%	EUR	100.41%	68 082	5 088 582
ABBEY 0.875% 01/2020	500 000	101.73%	EUR	101.73%	563	509 213
LLOYDS 0.625% 04/20	1 500 000	101.42%	EUR	101.42%	8 091	1 529 316
HSBC Float 09/22	750 000	101.43%	EUR	101.43%	495	761 190
F Float 08/20	300 000	100.65%	EUR	100.65%	4	301 966
WPPLN Float 05/20	800 000	100.36%	EUR	100.36%		802 856
SANUK Float 05/23	500 000	101.53%	EUR	101.53%	63	507 703
RBS Float 06/20	900 000	100.51%	EUR	100.51%	216	904 833
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	101.69%	EUR	101.69%	877	1 017 767
HSBC 0.17% 10/23	500 000	100.57%	EUR	100.57%	131	502 991
RBS Float 03/2020	100 000	100.35%	EUR	100.35%		100 346
TELEFO 4.693% 11/19	1 000 000	108.04%	EUR	108.04%	14 143	1 094 493
REDELE 4.875% 04/202	1 000 000	110.64%	EUR	110.64%	40 870	1 147 260
CABKSM 3.125% 05/18	4 000 000	100.64%	EUR	100.64%	99 658	4 125 378
SANTAN 1.1% 07/2018	2 000 000	100.55%	EUR	100.55%	12 959	2 023 939
SANSCF Float 01/19	600 000	100.24%	EUR	100.24%	99	601 527
IBESM Float 02/24	1 100 000	100.91%	EUR	100.91%	94	1 110 100
SANTAN Float 03/22	600 000	102.51%	EUR	102.51%	806	615 890
BBVASM Float 04/22	1 200 000	101.36%	EUR	101.36%	434	1 216 730
CRUNAV Float 06/2022	500 000	98.71%	EUR	98.71%	312	493 872
VLVY 2.375% 11/26/19	250 000	104.17%	EUR	104.17%	1 545	261 968
SCANIA Float 10/18	500 000	100.17%	EUR	100.17%	11	500 866
SCANIA Float 04/20	500 000	100.43%	EUR	100.43%	38	502 188
ENIIM 4.25% 02/20	700 000	108.20%	EUR	108.20%	2 119	759 540
ISPIM 1.125% 01/2020	1 600 000	102.05%	EUR	102.05%	2 268	1 635 036
ISPIM 4.125% 04/2020	750 000	108.64%	EUR	108.64%	27 208	842 038
UCGIM 5% 05/2018	475 000	101.14%	EUR	101.14%	18 479	498 885
UCGIM 5.65% 08/2018	1 000 000	102.75%	EUR	102.75%	29 256	1 056 756
UCGIM 6.1% 03/2018	600 000	100.24%	EUR	100.24%	35 096	636 536
ISPIM 2% 06/2021	1 000 000	105.38%	EUR	105.38%	14 027	1 067 837
ISPIM Float 04/22	450 000	102.28%	EUR	102.28%	319	460 556
GS 5.125% 10/2019	1 200 000	108.50%	EUR	108.50%	21 736	1 323 772
MS 2.25% 03/2018	2 000 000	100.06%	EUR	100.06%	43 644	2 044 784
BAC 2.5% 07/2020	750 000	105.86%	EUR	105.86%	11 147	805 097
JPM Float 06/2018	650 000	100.10%	EUR	100.10%		650 657
MS Float 01/22	500 000	101.11%	EUR	101.11%	161	505 726
MS Float 03/12/2019	200 000	100.30%	EUR	100.30%	84	200 678
BAC Float 02/22	200 000	101.53%	EUR	101.53%	58	203 116
BAC Float 05/23	400 000	101.49%	EUR	101.49%	121	406 093
GM Float 05/21	1 800 000	101.05%	EUR	101.05%	298	1 819 252
T Float 09/2023	1 500 000	101.69%	EUR	101.69%	1 889	1 527 269
TMO Float 07/2019	1 500 000	100.25%	EUR	100.25%		1 503 810
BATSLN Float 08/21	500 000	100.76%	EUR	100.76%	31	503 844
BAC Float 09/21	500 000	100.27%	EUR	100.27%	40	501 380

# CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-02-28

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
GS Float 09/23	1 100 000	100.32%	EUR	100.32%	569	1 104 034
UTX Float 11/19	1 500 000	100.44%	EUR	100.44%		1 506 555
CS 1.375% 11/2019	1 200 000	102.58%	EUR	102.58%	4 159	1 235 155
UBS Float 09/2019	400 000	100.65%	EUR	100.65%	166	402 782
REPSM 4.875% 02/2019	2 500 000	104.83%	EUR	104.83%	3 339	2 624 139
IBESM 4.25% 10/2018	1 200 000	102.70%	EUR	102.70%	19 701	1 252 089
ENELIM 4.875% 03/20	1 250 000	109.91%	EUR	109.91%	59 268	1 433 118
REPSM 2.625% 05/2020	2 500 000	105.92%	EUR	105.92%	49 803	2 697 678
IBESM 2.875% 11/2020	1 000 000	107.59%	EUR	107.59%	8 664	1 084 604
RENEPL 4.75% 10/2020	1 000 000	112.23%	EUR	112.23%	17 699	1 139 959
ACHMEA 2.5% 11/2020	2 800 000	106.41%	EUR	106.41%	19 562	2 999 070
NOMURA 1.125% 06/20	1 000 000	102.23%	EUR	102.23%	8 353	1 030 643
ACHMEA 0.875% 09/18	4 000 000	100.61%	EUR	100.61%	15 822	4 040 142
ABNANV Float 01/19	600 000	100.42%	EUR	100.42%	128	602 648
MYL FLOAT 11/18	1 200 000	100.45%	EUR	100.45%	126	1 205 538
VW 0.5% 03/21	600 000	100.75%	EUR	100.75%	2 762	607 286
VW Float 03/19	600 000	100.22%	EUR	100.22%	22	601 360
BMW 0.125% 07/20	3 000 000	100.34%	EUR	100.34%	2 476	3 012 556
LPTY Float 11/20	800 000	100.60%	EUR	100.60%	102	804 894
MYL Float 05/20	800 000	100.25%	EUR	100.25%	19	802 035
PHIANA Float 09/2019	750 000	100.41%	EUR	100.41%		753 105
AKZANA Float 11/19	900 000	100.40%	EUR	100.40%		903 555
ANNGR FLOAT 11/19	500 000	100.43%	EUR	100.43%	3	502 143
ALVGR Float 12/20	300 000	101.27%	EUR	101.27%	123	303 939
LPTY Float 01/21	200 000	100.53%	EUR	100.53%	34	201 094
SYDBDC Float 05/18	500 000	100.09%	EUR	100.09%	21	500 476
NYKRE Float 06/22	1 000 000	100.89%	EUR	100.89%	582	1 009 472
JYBC Float 06/20	1 000 000	100.43%	EUR	100.43%	51	1 004 371
KBCBB Float 11/22	500 000	101.20%	EUR	101.20%	9	506 014
GE 2.875% 06/2019	1 000 000	103.86%	EUR	103.86%	20 164	1 058 764
GE 2.25% 07/2020	2 000 000	105.11%	EUR	105.11%	27 616	2 129 876
DLTAS 2008-1 A	1 058 554	100.06%	EUR	100.06%	37	1 059 184
DHR Float 06/22	700 000	100.48%	EUR	100.48%		703 388
DE Float 09/20	1 000 000	100.47%	EUR	100.47%		1 004 650
SUMIBK Float 06/22	500 000	100.64%	EUR	100.64%	132	503 327
BMO Float 09/21	750 000	101.22%	EUR	101.22%	224	759 359
BNS FLOAT 10/22	1 000 000	101.80%	EUR	101.80%	414	1 018 374
ICBCAS FLOAT 10/20	1 000 000	100.28%	EUR	100.28%	295	1 003 115
BCHINA Float 11/20	300 000	100.27%	EUR	100.27%	8	300 824
AMXLMM 4.125%10/2019	700 000	106.83%	EUR	106.83%	10 047	757 836
AMXLMM 1% 06/2018	2 500 000	100.23%	EUR	100.23%	18 493	2 524 343
CAFP FLT 03/18	700 000	100.04%	EUR	100.04%	595	700 840
GLENLN 2.625% 11/18	800 000	101.86%	EUR	101.86%	5 868	820 716
BACR Float 03/2021	900 000	96.98%	EUR	96.98%	243	873 063
CCBGBB Float 03/18	500 000	100.02%	EUR	100.02%	166	500 241
GSFloat 10/2019	50 000	101.03%	EUR	101.03%	18	50 533
GS Float 09/2018	500 000	100.31%	EUR	100.31%	361	501 916

## CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-02-28

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BAC Float 05/2019	700 000	101.29%	EUR	101.29%	506	709 529
C Float 11/2019	100 000	100.81%	EUR	100.81%	10	100 820
ANNGR Float 09/18	500 000	100.12%	EUR	100.12%	57	500 662
UNANA Float 06/18	500 000	100.08%	EUR	100.08%		500 375
BSN Float 09/2018	500 000	100.20%	EUR	100.20%	61	501 071
BATSLN Float 03/2018	500 000	100.00%	EUR	100.00%	205	500 225
RY Float 03/2019	300 000	100.47%	EUR	100.47%	65	301 469
RY Float 10/2018	500 000	100.28%	EUR	100.28%	54	501 464
DAIGR Float 01/2019	200 000	100.39%	EUR	100.39%	54	200 828
DAIGR Float 03/18	100 000	100.01%	EUR	100.01%	34	100 043
VOD Float 02/2019	200 000	100.89%	EUR	100.89%	10	201 798
RENAUL Float 03/19	600 000	100.94%	EUR	100.94%	814	606 448
NDASS Float 02/19	200 000	100.43%	EUR	100.43%	5	200 869
CAT Float 05/2018	200 000	100.04%	EUR	100.04%		200 088
UCGIM Float 02/2020	650 000	101.55%	EUR	101.55%	121	660 209
MAERSK Float 03/19	200 000	101.51%	EUR	101.51%	515	203 541
COVEGR Float 03/18	200 000	100.01%	EUR	100.01%	122	200 140
FDX Float 04/19	300 000	100.49%	EUR	100.49%	90	301 569
CAPFP Float 07/2018	700 000	100.06%	EUR	100.06%	588	701 001
VW Float 07/2018	100 000	100.10%	EUR	100.10%		100 095
BPCEGP Float 05/2018	500 000	100.16%	EUR	100.16%	5	500 790
ISPIM Float 04/2019	600 000	101.00%	EUR	101.00%	517	606 505
ISPIM Float 06/20	200 000	101.85%	EUR	101.85%	304	204 002
NWIDE Float 11/2018	700 000	100.33%	EUR	100.33%	90	702 421
BMW Float 04/2018	700 000	100.04%	EUR	100.04%		700 259
SWEDA FLOAT 08/2020	200 000	101.13%	EUR	101.13%	10	202 262
SWEDA FLOAT 03/19	200 000	100.77%	EUR	100.77%	189	201 737
						153 090 937
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					30 883	7 121 842
Obrigações diversas						
HUWY 1.375% 10/2021	2 000 000	103.55%	EUR	103.55%	9 116	2 080 076
K 1.75% 05/2021	1 000 000	104.80%	EUR	104.80%	13 473	1 061 503
KO Float 03/19	300 000	100.32%	EUR	100.32%		300 969
UBS Float 09/22	1 000 000	101.37%	EUR	101.37%	732	1 014 472
AGN Float 06/19	1 000 000	100.18%	EUR	100.18%	53	1 001 843
WESAU 1.25% 10/2021	1 500 000	103.66%	EUR	103.66%	7 449	1 562 289
AT&T Float 06/19	100 000	100.63%	EUR	100.63%	61	100 691
						7 121 842
						174 842 278
<b>UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)</b>						
OIC domiciliados em Portugal						36 955 310
CXG OBRIGAÇÕES	2 258 307	4.48	EUR	4.48		10 125 569
CXG LIQUIDEZ	5 021 569	5.34	EUR	5.34		26 829 741
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						24 924 581
AXA WF EUR SD-I-XC€	248 649	100.24	EUR	100.24		24 924 581

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA  
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE  
Composição da Carteira em 2018-02-28

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
						61 879 891
LIQUIDEZ						
À vista						12 854 992
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.0000%				EUR		12 854 992
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
Valores Passivos						-225 435
						-225 435
						249 351 726
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					42 227 428.74	

Valor da Unidade de Participação: € 5.9050