

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2013-08-31

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.					3 499	190 436
Títulos de Dívida Pública						
OT 3.6% OUT/2014	31 000	99.67%	EUR	99.67%	981	31 878
Obrigações diversas						
CXGD 3.625% 07/2014	50 000	100.52%	EUR	100.52%	209	50 469
SANTAN 3.25% 10/2014	50 000	100.98%	EUR	100.98%	1 402	51 891
BESPL 3.375% 02/15	50 000	99.57%	EUR	99.57%	906	50 690
						153 050
Acções						
J.MARTINS-PO	375	14.69	EUR	14.69		5 509
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					26 415	3 810 280
Títulos de Dívida Pública						
DBR 6.25% 01/2024	35 000	140.94%	EUR	140.94%	1 438	50 767
DBR 4% 04/01/37	35 000	123.75%	EUR	123.75%	921	44 231
DBR 3.75% 01/2017	61 000	110.92%	EUR	110.92%	1 504	69 165
DBR 1.75% 07/04/22	38 000	100.62%	EUR	100.62%	107	38 343
FRTR 3.25% 25/4/2016	12 000	107.12%	EUR	107.12%	138	12 992
FRTR 4.25% 10/2023	23 000	115.05%	EUR	115.05%	833	27 293
FRANCE O.A.T 4.25	26 000	113.01%	EUR	113.01%	942	30 323
FRTR 4.5% 04/2041	57 000	118.50%	EUR	118.50%	907	68 449
FRTR 3% 04/2022	86 000	106.03%	EUR	106.03%	912	92 098
SPGB 4.8% 01/2024	67 000	101.60%	EUR	101.60%	1 877	69 949
SPGB 5.5% 04/2021	57 000	109.01%	EUR	109.01%	1 065	63 201
SPGB 3.3% 10/2014	31 000	102.06%	EUR	102.06%	855	32 493
BTPS 3.75% 12/2013	36 000	100.87%	EUR	100.87%	288	36 599
BTPS 5% 09/2040	48 000	99.57%	EUR	99.57%	1 200	48 991
BTPS 5% 03/2025	48 000	104.20%	EUR	104.20%	1 200	51 216
BTPS 3.75% 08/2016	115 000	103.71%	EUR	103.71%	363	119 624
BTPS 3% 11/2015	41 000	102.10%	EUR	102.10%	411	42 272
BTPS 5.5% 09/2022	78 000	108.53%	EUR	108.53%	2 145	86 795
NETHER 3.75% 01/23	74 000	113.56%	EUR	113.56%	1 741	85 772
BGB 3.5% 06/2017	97 000	108.86%	EUR	108.86%	605	106 194
RAGB 4.85 03/2026	40 000	124.95%	EUR	124.95%	904	50 884
CCTS Float 06/15/17	50 000	101.39%	EUR	101.39%	306	51 001
						1 278 651
Obrigações diversas						
BCPN Float 05/14	10 000	96.95%	EUR	96.95%	2	9 697
BMW Float 09/2016	50 000	99.99%	EUR	99.99%		49 993
CGD S.758 12/2017	650 000	78.83%	EUR	78.83%	2 455	514 882
CXGD 8% 09/2015	32 000	106.47%	EUR	106.47%	2 371	36 442
UAB S.11 10/2013	57 408	90.63%	EUR	90.63%	26	52 054
SANTAN Float 09/2016	50 000	98.94%	EUR	98.94%	164	49 632
LLOYDS BANK Float 16	50 000	97.44%	EUR	97.44%	76	48 795

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2013-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BNP Float 12/2014	50 000	100.21%	EUR	100.21%	72	50 177
MS Float 04/2016	50 000	98.64%	EUR	98.64%	41	49 361
BAC Float 05/2016	50 000	98.83%	EUR	98.83%	8	49 421
Citigroup Flt.03/14	50 000	99.99%	EUR	99.99%	42	50 035
UBS Float 05/2014	20 000	100.30%	EUR	100.30%	6	20 066
TELEFO Float 06/2015	50 000	101.20%	EUR	101.20%	253	50 851
DB Float 09/2016	15 000	97.83%	EUR	97.83%	31	14 704
GE Float 02/2016	55 000	99.23%	EUR	99.23%	6	54 584
ENELIM Float 01/2015	50 000	99.79%	EUR	99.79%	75	49 971
ENELIM Float 02/2016	30 000	98.83%	EUR	98.83%	5	29 654
BAVB Float 10/14	30 000	98.99%	EUR	98.99%	22	29 717
UCGIM Float 02/2014	30 000	99.79%	EUR	99.79%	9	29 946
UBIIM Float 07/2014	50 000	99.19%	EUR	99.19%	21	49 617
RABOBK Float 01/2014	10 000	100.24%	EUR	100.24%	12	10 036
Intned Float 03/2016	15 000	96.77%	EUR	96.77%	28	14 542
Intned Float 04/2016	50 000	98.89%	EUR	98.89%	30	49 476
						1 363 655
Acções						
BMW	365	71.29	EUR	71.29		26 021
DEUTSCHE BANK	741	32.76	EUR	32.76		24 275
SIEMENS	656	80.09	EUR	80.09		52 539
ALLIANZ	281	108.40	EUR	108.40		30 460
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 002	11.98	EUR	11.98		12 004
BASF	620	66.13	EUR	66.13		41 001
BAYER AG	414	84.04	EUR	84.04		34 793
MUNCHENER RUCKVERS.	122	137.90	EUR	137.90		16 824
ADIDAS- SALOMON AG	262	80.00	EUR	80.00		20 960
BEIERSDORF AG	292	65.20	EUR	65.20		19 038
HENKEL KGAA PREF.	259	73.30	EUR	73.30		18 985
SAP ORD.	406	55.93	EUR	55.93		22 708
THYSSEN KRUPP	841	15.91	EUR	15.91		13 376
FRESENIUS MEDICAL CA	219	49.19	EUR	49.19		10 772
VOLKSWAGEN AG-PREF.	197	172.10	EUR	172.10		33 904
OSRAM LICHT AG	62	30.38	EUR	30.38		1 884
GEN DES EAUX/VIVENDI	839	15.35	EUR	15.35		12 874
DANONE	404	56.34	EUR	56.34		22 761
AXA-UAP	489	16.49	EUR	16.49		8 061
CARREFOUR	256	23.69	EUR	23.69		6 063
TOTAL SA	892	41.92	EUR	41.92		37 388
Kering	42	170.90	EUR	170.90		7 178
BNP	673	47.42	EUR	47.42		31 910
AIR LIQUIDE	101	99.51	EUR	99.51		10 051
L.V.M.H.	81	132.55	EUR	132.55		10 737
MICHELIN	129	72.39	EUR	72.39		9 338
RENAULT SA	274	54.08	EUR	54.08		14 818
SOCIÉTÉ GENERALE	727	33.12	EUR	33.12		24 075

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2013-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
GLE ENTREP. VINCI	702	39.07	EUR	39.07		27 427
SANOFI SYNHLABO	671	72.69	EUR	72.69		48 775
EADS	584	43.61	EUR	43.61		25 465
SUEZ ENVIRONNEMENT S	721	11.28	EUR	11.28		8 129
EDF	275	21.20	EUR	21.20		5 830
LLOYDS BANK	8 519	0.73	GBP	0.85		7 238
BARCLAYS	3 792	2.83	GBP	3.32		12 582
WEIR GROUP PLC	240	21.75	GBP	25.47		6 113
DE LA RUE PLC	269	9.96	GBP	11.66		3 136
AFREN PLC	9 876	1.39	GBP	1.63		16 099
ASHTED GROUP PLC	1 481	6.45	GBP	7.55		11 186
JAZZTEL PLC	1 357	6.87	EUR	6.87		9 323
BANCO POPULAR	3 429	3.55	EUR	3.55		12 183
TELEFONICA	2 648	10.28	EUR	10.28		27 208
BCO SANTANDER C.HISP	6 483	5.34	EUR	5.34		34 619
GAS NATURAL	494	14.82	EUR	14.82		7 321
IBERDROLA	2 683	4.01	EUR	4.01		10 764
REPSOL	883	17.56	EUR	17.56		15 501
BCO. BILBAO VISCAYA	2 079	7.22	EUR	7.22		15 010
FERROVIAL	1 487	12.55	EUR	12.55		18 662
DISTRIBINTERNACIONAL	1 074	5.98	EUR	5.98		6 423
UNICREDITO ITALIANO	1 589	4.28	EUR	4.28		6 798
BANCA INTESA	4 944	1.49	EUR	1.49		7 342
FINMECCANICA	1 724	3.87	EUR	3.87		6 672
TERNA SPA	2 316	3.23	EUR	3.23		7 485
AEGON NV	3 044	5.40	EUR	5.40		16 425
ING GROEP NV	2 824	8.22	EUR	8.22		23 199
UNILEVER NV-CVA	599	28.43	EUR	28.43		17 027
ASML NA	219	66.31	EUR	66.31		14 522
AKZO NOBEL NV NLG20	465	44.50	EUR	44.50		20 690
SBM OFFSHORE NV	988	14.87	EUR	14.87		14 687
NOKIA A	3 346	2.93	EUR	2.93		9 790
UPM-KYMMENE	2 091	9.14	EUR	9.14		19 101
Neste Oil Oyj	1 117	13.90	EUR	13.90		15 526
SOLVAY SA	109	105.40	EUR	105.40		11 489
ANHEUSER-BUSCH INB	714	70.38	EUR	70.38		50 251
BELGACOM SA	858	18.10	EUR	18.10		15 530
OMV AG	219	34.93	EUR	34.93		7 650
						1 167 975
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU						53 982
Acções						
NOVARTIS REG	225	67.85	CHF	55.12		12 402
C.S.HOLD./GROUP-REG	347	26.82	CHF	21.79		7 560
C.FIN.RICHMONT	264	88.40	CHF	71.81		18 958
MARINE HARVEST	21 436	5.69	NOK	0.70		15 063
						53 982

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2013-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
						4 054 699
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC domiciliados em Portugal						832 390
Ups de OIC abertos						
CXG OB MAIS MENSAL	37 127	4.18	EUR	4.18		155 196
CXG IMOBILIARIO	53 412	3.27	EUR	3.27		174 486
FEI CX F. MONETARIO	29 495	5.50	EUR	5.50		162 211
F.I.MOB.IMOSOCIAL	16 827	6.34	EUR	6.34		106 698
IBERIA F.INV.IMOB	4 595	0.00	EUR	0.00		3
FUNDIESTAMO I	58	1 020.91	EUR	1 020.91		59 213
Fnd I.Imob. MAXIRENT	7 207	11.41	EUR	11.41		82 215
LOGISTICA E DISTRIB.	16 788	5.50	EUR	5.50		92 366
						832 390
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						2 039 613
Ups de OIC harmonizados						
HSBC EURO GVT BOND F	66	2 802.36	EUR	2 802.36		184 956
PETERCAM BdEUR InG-F	5 700	57.19	EUR	57.19		325 983
BROCK EURO MKT Fd D2	17 523	21.40	EUR	21.40		374 992
BNPP L1 EQTY EURO I	1 229	298.07	EUR	298.07		366 328
PIONEER EUROLND EQ I	65 237	6.24	EUR	6.24		407 079
ROBECO EUR GOV BD I	770	138.37	EUR	138.37		106 545
ALLIANZ EUROLND EQY G	120	1 560.02	EUR	1 560.02		187 202
ISHARES EUROP MINVOL	3 200	27.04	EUR	27.04		86 528
						2 039 613
						2 872 003
LIQUIDEZ						
À vista					14	14
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.1048%			EUR		14	14
A prazo					24 969	1 587 969
Depósitos com pré aviso e a prazo						
DP DP CGD 4/7 368D 2.7500% 2013-07-04 a 2014-07-07			EUR		766	170 766
DP DP CGD 01/02 354d 2.9500% 2013-02-01 a 2014-01-21			EUR		1 268	74 268
DP DP CGD 27/06 363d 2.7500% 2013-06-27 a 2014-06-25			EUR		1 260	251 260
DP DP CGD 29/07 365d 2.7500% 2013-07-29 a 2014-07-29			EUR		208	80 208
DP DP CGD 28/9 368d 2.9000% 2012-09-28 a 2013-10-01			EUR		2 723	102 723
DP DP CGD 30-10 395d 3.1500% 2012-10-30 a 2013-11-29			EUR		803	30 803
DP DP CGD 28/03 391d 3.0000% 2013-03-28 a 2014-04-23			EUR		2 093	162 093
DP DP CGD 21/12 364d 3.0500% 2012-12-21 a 2013-12-20			EUR		10 222	485 222
DP DP CGD 10/10 359d 3.0000% 2012-10-10 a 2013-10-04			EUR		4 075	154 075
DP DP CGD 31/12 354d 3.0500% 2012-12-31 a 2013-12-20			EUR		1 550	76 550
						1 587 969
						1 587 983

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
Composição da Carteira em 2013-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
Valores Activos						200 804
Valores Passivos						-102 356
						98 448
						8 613 133
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
VGU3-EUR EUX09/2013	3	2 721.00	EUR	2 721.00		81 630
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					1 614 982.94	

Valor da Unidade de Participação 5.3333 €