

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2013-06-30

| Designação | Quantidade | Preço Unit. | Mda | Preço Unit. (EUR) | Juro Corrido (EUR) | Valor Total (EUR) |
|---|------------|-------------|-----|----------------------|-----------------------|----------------------|
| COMPOSIÇÃO DISCRIMINADA CARTEIRA | | | | | | |
| R Rodrigo Fonseca | 5 | 594 400.00 | EUR | 594 400.00 | | 2 972 000 |
| REPUBLICA 35- R/C | 8 | 553 625.00 | EUR | 553 625.00 | | 4 429 000 |
| VALORES MOBILIÁRIOS COTADOS | | | | | | |
| Merc. Cot. Oficiais de Bolsa Val. Port. | | | | | 11 143 | 541 752 |
| Títulos de Dívida Pública | | | | | | |
| OT 3.6% OUT/2014 | 172 000 | 100.15% | EUR | 100.15% | 4 394 | 176 643 |
| Obrigações diversas | | | | | | |
| SANTAN 3.25% 10/2014 | 150 000 | 101.28% | EUR | 101.28% | 3 379 | 155 304 |
| CXGD 3.75% 01/2018 | 200 000 | 99.15% | EUR | 99.15% | 3 370 | 201 678 |
| | | | | | | 356 981 |
| Acções | | | | | | |
| J.MARTINS-PO | 502 | 16.19 | EUR | 16.19 | | 8 127 |
| Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE | | | | | 91 956 | 24 048 163 |
| Títulos de Dívida Pública | | | | | | |
| DBR 6.25% 01/2024 | 80 000 | 143.08% | EUR | 143.08% | 2 438 | 116 898 |
| DBR 4% 04/01/37 | 156 000 | 127.45% | EUR | 127.45% | 3 043 | 201 865 |
| DBR 3.75% 01/2017 | 104 000 | 111.62% | EUR | 111.62% | 1 902 | 117 987 |
| OBL 4% 10/2013 | 120 000 | 101.08% | EUR | 101.08% | 3 459 | 124 761 |
| DBR 1.75% 07/04/22 | 63 000 | 101.55% | EUR | 101.55% | 1 341 | 65 314 |
| FRTR 3.25% 25/4/2016 | 277 000 | 107.44% | EUR | 107.44% | 1 653 | 299 261 |
| FRANCE O.A.T 4.25 | 60 000 | 113.55% | EUR | 113.55% | 1 740 | 69 867 |
| FRTR 4.5% 04/2041 | 238 000 | 121.78% | EUR | 121.78% | 1 966 | 291 802 |
| FRTR 3% 04/2022 | 434 000 | 106.81% | EUR | 106.81% | 2 390 | 465 924 |
| SPGB 4.8% 01/2024 | 281 000 | 99.71% | EUR | 99.71% | 5 580 | 285 765 |
| SPGB 3.15% 01/2016 | 90 000 | 100.93% | EUR | 100.93% | 1 173 | 92 005 |
| SPGB 5.5% 04/2021 | 310 000 | 107.35% | EUR | 107.35% | 2 896 | 335 666 |
| BTPS 4.25% 09/2019 | 60 000 | 102.68% | EUR | 102.68% | 845 | 62 453 |
| BTPS 5% 09/2040 | 213 000 | 99.81% | EUR | 99.81% | 3 531 | 216 115 |
| BTPS 5% 03/2025 | 213 000 | 103.36% | EUR | 103.36% | 3 531 | 223 677 |
| BTPS 3.75% 08/2016 | 580 000 | 103.18% | EUR | 103.18% | 9 012 | 607 456 |
| BTPS 3% 11/2015 | 364 000 | 101.57% | EUR | 101.57% | 1 810 | 371 507 |
| BTPS 5.5% 09/2022 | 185 000 | 107.54% | EUR | 107.54% | 3 373 | 202 313 |
| NETHER 3.75% 01/23 | 337 000 | 115.34% | EUR | 115.34% | 5 782 | 394 461 |
| BGB 3.5% 06/2017 | 468 000 | 109.16% | EUR | 109.16% | 135 | 510 980 |
| RAGB 4.85 03/2026 | 168 000 | 127.13% | EUR | 127.13% | 2 411 | 215 989 |
| RAGB 3.5% 07/2015 | 206 000 | 106.40% | EUR | 106.40% | 6 933 | 226 117 |
| | | | | | | 5 498 185 |
| Obrigações diversas | | | | | | |
| CMZB Float 10/2013 | 350 000 | 100.45% | EUR | 100.45% | 1 112 | 352 683 |
| ITFIN 2005-1 A2/20 | 5 502 | 98.85% | EUR | 98.85% | 1 | 5 440 |
| NDASS 2.25% 05/2019 | 100 000 | 104.15% | EUR | 104.15% | 364 | 104 509 |
| MAGEL 4 D 07/2059 | 129 430 | 40.00% | EUR | 40.00% | 191 | 51 963 |

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2013-06-30

| Designação | Quantidade | Preço Unit. | Mda | Preço Unit. (EUR) | Juro Corrido (EUR) | Valor Total (EUR) |
|----------------------|------------|-------------|-----|----------------------|-----------------------|----------------------|
| CGD S.758 12/2017 | 4 050 000 | 75.22% | EUR | 75.22% | 2 818 | 3 049 057 |
| CAFP Float 04/2016 | 300 000 | 100.16% | EUR | 100.16% | 671 | 301 151 |
| Telecom Italia 07/13 | 250 000 | 99.99% | EUR | 99.99% | 426 | 250 398 |
| SANT.CONS.FIN.Flt 16 | 250 000 | 89.08% | EUR | 89.08% | 22 | 222 731 |
| SANTAN Float 10/2013 | 550 000 | 100.32% | EUR | 100.32% | 1 594 | 553 354 |
| LLOYDS BANK Float 16 | 250 000 | 95.78% | EUR | 95.78% | 582 | 240 020 |
| BNP Float 12/2014 | 130 000 | 100.21% | EUR | 100.21% | 58 | 130 331 |
| HSBC Float 09/2020 | 200 000 | 96.68% | EUR | 96.68% | 9 | 193 359 |
| MS Float 04/2016 | 350 000 | 97.72% | EUR | 97.72% | 457 | 342 477 |
| BAC Float 02/2014 | 500 000 | 99.87% | EUR | 99.87% | 268 | 499 628 |
| Citigroup Flt.03/14 | 400 000 | 99.95% | EUR | 99.95% | 98 | 399 906 |
| WSTP Float 10/2013 | 200 000 | 100.15% | EUR | 100.15% | 230 | 200 526 |
| AAB Float 06/2015 | 414 000 | 95.40% | EUR | 95.40% | 229 | 395 185 |
| ABNANV Float 10/2013 | 100 000 | 100.32% | EUR | 100.32% | 341 | 100 658 |
| UBS Float 05/2014 | 300 000 | 100.40% | EUR | 100.40% | 269 | 301 481 |
| TELEFO Float 06/2015 | 350 000 | 101.11% | EUR | 101.11% | 551 | 354 450 |
| SOCGEN Float 01/2015 | 500 000 | 100.15% | EUR | 100.15% | 707 | 501 447 |
| VLVY Float 05/2016 | 350 000 | 100.05% | EUR | 100.05% | 449 | 350 631 |
| DB Float 09/2016 | 100 000 | 96.69% | EUR | 96.69% | 31 | 96 719 |
| NYKRE Float 01/2014 | 200 000 | 100.89% | EUR | 100.89% | 726 | 202 514 |
| DAIGR Float 04/2015 | 500 000 | 99.79% | EUR | 99.79% | 501 | 499 459 |
| KBC Float 07/13 | 350 000 | 100.07% | EUR | 100.07% | 1 320 | 351 555 |
| SYDBDC Float 02/2014 | 100 000 | 100.95% | EUR | 100.95% | 198 | 101 147 |
| GE Float 02/2016 | 600 000 | 99.31% | EUR | 99.31% | 233 | 596 063 |
| GE Float 04/2014 | 400 000 | 100.01% | EUR | 100.01% | 347 | 400 375 |
| ENELIM Float 01/2015 | 400 000 | 99.12% | EUR | 99.12% | 2 100 | 398 560 |
| BAVB Float 10/14 | 50 000 | 98.65% | EUR | 98.65% | 52 | 49 375 |
| JYBC Float 05/2015 | 300 000 | 101.17% | EUR | 101.17% | 456 | 303 969 |
| UCGIM Float 01/2016 | 600 000 | 99.38% | EUR | 99.38% | 1 133 | 597 383 |
| UBIIM Float 07/2014 | 500 000 | 98.67% | EUR | 98.67% | 362 | 493 712 |
| UBIIM Float 12/2014 | 300 000 | 98.69% | EUR | 98.69% | 270 | 296 346 |
| SEB Float 10/2013 | 100 000 | 100.35% | EUR | 100.35% | 264 | 100 613 |
| CCCI Float 08/2013 | 400 000 | 100.18% | EUR | 100.18% | 1 827 | 402 539 |
| ACAFP Float 01/2015 | 200 000 | 100.09% | EUR | 100.09% | 261 | 200 439 |
| LANISL Float 05/2012 | 200 000 | 7.25% | EUR | 7.25% | | 14 500 |
| BPCEGP Float 12/2014 | 400 000 | 100.18% | EUR | 100.18% | 188 | 400 912 |
| ISPIM Float 07/2015 | 800 000 | 100.00% | EUR | 100.00% | 2 388 | 802 356 |
| Intned Float 04/2016 | 400 000 | 98.78% | EUR | 98.78% | 370 | 395 482 |
| INTNED Float 11/2014 | 500 000 | 100.34% | EUR | 100.34% | 326 | 502 006 |
| IBSANP Float 02/2018 | 44 000 | 86.75% | EUR | 86.75% | 54 | 38 224 |
| DANBNK Float 03/2014 | 200 000 | 100.57% | EUR | 100.57% | 121 | 201 255 |
| JPM Float 09/2013 | 600 000 | 100.05% | EUR | 100.05% | 39 | 600 327 |
| | | | | | | 16 947 212 |
| Acções | | | | | | |
| DEUTSCHE BANK | 733 | 32.16 | EUR | 32.16 | | 23 570 |
| SIEMENS | 887 | 77.65 | EUR | 77.65 | | 68 876 |
| ALLIANZ | 399 | 112.25 | EUR | 112.25 | | 44 788 |

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2013-06-30

| Designação | Quantidade | Preço Unit. | Mda | Preço Unit. (EUR) | Juro Corrido (EUR) | Valor Total (EUR) |
|----------------------|------------|-------------|-----|----------------------|-----------------------|----------------------|
| E.ON AG(EX VEBA AG) | 1 375 | 12.61 | EUR | 12.61 | | 17 339 |
| BASF | 882 | 68.63 | EUR | 68.63 | | 60 532 |
| BAYER AG | 600 | 81.93 | EUR | 81.93 | | 49 158 |
| MUNCHENER RUCKVERS. | 154 | 141.40 | EUR | 141.40 | | 21 776 |
| ADIDAS- SALOMON AG | 166 | 83.14 | EUR | 83.14 | | 13 801 |
| BEIERSDORF AG | 415 | 67.00 | EUR | 67.00 | | 27 805 |
| HENKEL KGAA PREF. | 371 | 72.25 | EUR | 72.25 | | 26 805 |
| SAP ORD. | 669 | 56.26 | EUR | 56.26 | | 37 638 |
| FRESENIUS MEDICAL CA | 245 | 54.53 | EUR | 54.53 | | 13 360 |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 225 | 50.57 | EUR | 50.57 | | 11 378 |
| VOLKSWAGEN AG-PREF. | 274 | 155.55 | EUR | 155.55 | | 42 621 |
| GEN DES EAUX/VIVENDI | 1 580 | 14.55 | EUR | 14.55 | | 22 989 |
| DANONE | 575 | 57.66 | EUR | 57.66 | | 33 155 |
| AXA-UAP | 695 | 15.10 | EUR | 15.10 | | 10 491 |
| CARREFOUR | 364 | 21.13 | EUR | 21.13 | | 7 691 |
| TOTAL SA | 1 565 | 37.51 | EUR | 37.51 | | 58 695 |
| Kering | 59 | 156.15 | EUR | 156.15 | | 9 213 |
| BNP | 965 | 41.98 | EUR | 41.98 | | 40 506 |
| AIR LIQUIDE | 185 | 94.87 | EUR | 94.87 | | 17 551 |
| L.V.M.H. | 116 | 124.50 | EUR | 124.50 | | 14 442 |
| MICHELIN | 184 | 68.70 | EUR | 68.70 | | 12 641 |
| RENAULT SA | 389 | 51.70 | EUR | 51.70 | | 20 111 |
| SOCIETE GENERALE | 805 | 26.40 | EUR | 26.40 | | 21 252 |
| VALEO SA | 484 | 48.29 | EUR | 48.29 | | 23 370 |
| GLE ENTREP. VINCI | 1 106 | 38.56 | EUR | 38.56 | | 42 642 |
| SANOFI SYNHLABO | 968 | 79.62 | EUR | 79.62 | | 77 072 |
| EADS | 1 003 | 41.07 | EUR | 41.07 | | 41 188 |
| SUEZ ENVIRONNEMENT S | 1 349 | 9.92 | EUR | 9.92 | | 13 387 |
| ARKEMA | 159 | 70.53 | EUR | 70.53 | | 11 214 |
| EDF | 429 | 17.84 | EUR | 17.84 | | 7 651 |
| BARCLAYS | 4 381 | 2.78 | GBP | 3.25 | | 14 231 |
| WEIR GROUP PLC | 357 | 21.51 | GBP | 25.09 | | 8 958 |
| FRESNILLO PLC | 1 167 | 8.82 | GBP | 10.29 | | 12 008 |
| DE LA RUE PLC | 384 | 9.67 | GBP | 11.28 | | 4 330 |
| AFREN PLC | 7 999 | 1.30 | GBP | 1.51 | | 12 084 |
| ASHTREAD GROUP PLC | 2 357 | 6.46 | GBP | 7.53 | | 17 749 |
| JAZZTEL PLC | 1 931 | 5.97 | EUR | 5.97 | | 11 528 |
| BANCO POPULAR | 5 233 | 2.36 | EUR | 2.36 | | 12 324 |
| TELEFONICA | 3 556 | 9.85 | EUR | 9.85 | | 35 009 |
| BCO SANTANDER C.HISP | 7 911 | 4.90 | EUR | 4.90 | | 38 780 |
| GAS NATURAL | 703 | 15.49 | EUR | 15.49 | | 10 889 |
| IBERDROLA | 3 815 | 4.06 | EUR | 4.06 | | 15 474 |
| REPSOL | 1 359 | 16.21 | EUR | 16.21 | | 22 029 |
| BCO. BILBAO VISCAYA | 3 686 | 6.45 | EUR | 6.45 | | 23 756 |
| FERROVIAL | 2 043 | 12.28 | EUR | 12.28 | | 25 088 |
| INDITEX | 176 | 94.84 | EUR | 94.84 | | 16 692 |
| TECNICAS REUNIDAS SA | 358 | 35.30 | EUR | 35.30 | | 12 636 |

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2013-06-30

| Designação | Quantidade | Preço Unit. | Mda | Preço Unit. (EUR) | Juro Corrido (EUR) | Valor Total (EUR) |
|---|------------|-------------|-----|----------------------|-----------------------|----------------------|
| DISTRINTERNACIONAL | 1 527 | 5.81 | EUR | 5.81 | | 8 872 |
| UNICREDITO ITALIANO | 2 279 | 3.60 | EUR | 3.60 | | 8 200 |
| ENI SPA | 1 249 | 15.78 | EUR | 15.78 | | 19 709 |
| BANCA INTESA | 13 490 | 1.23 | EUR | 1.23 | | 16 606 |
| TERNA SPA | 3 325 | 3.19 | EUR | 3.19 | | 10 613 |
| AEGON NV | 4 360 | 5.14 | EUR | 5.14 | | 22 406 |
| ING GROEP NV | 4 746 | 7.00 | EUR | 7.00 | | 33 222 |
| UNILEVER NV-CVA | 858 | 30.26 | EUR | 30.26 | | 25 959 |
| AKZO NOBEL NV NLG20 | 665 | 43.32 | EUR | 43.32 | | 28 804 |
| NOVO NORDISK AS | 146 | 893.00 | DKK | 119.72 | | 17 480 |
| NOKIA A | 11 102 | 2.85 | EUR | 2.85 | | 31 596 |
| UPM-KYMMENE | 1 815 | 7.53 | EUR | 7.53 | | 13 667 |
| SAMPO OYJ-A SHS | 313 | 29.94 | EUR | 29.94 | | 9 371 |
| SOLVAY SA | 154 | 100.70 | EUR | 100.70 | | 15 508 |
| ANHEUSER-BUSCH INB | 1 015 | 68.39 | EUR | 68.39 | | 69 416 |
| BELGACOM SA | 1 219 | 17.24 | EUR | 17.24 | | 21 009 |
| OMV AG | 344 | 34.70 | EUR | 34.70 | | 11 937 |
| | | | | | | 1 602 647 |
| Direitos | | | | | | |
| GROUP FNAC Dir.Inc | 59 | 2.00 | EUR | 2.00 | | 118 |
| Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU | | | | | | 59 384 |
| Acções | | | | | | |
| C.S.HOLD./GROUP-REG | 493 | 25.05 | CHF | 20.30 | | 10 009 |
| C.FIN.RICHMONT | 377 | 83.55 | CHF | 67.72 | | 25 530 |
| MARINE HARVEST | 30 520 | 6.16 | NOK | 0.78 | | 23 845 |
| | | | | | | 59 384 |
| | | | | | | 24 649 298 |
| UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC) | | | | | | |
| OIC domiciliados em Portugal | | | | | | 2 092 978 |
| UPs de OIC abertos | | | | | | |
| CXG OB MAIS MENSAL | 415 859 | 4.16 | EUR | 4.16 | | 1 728 143 |
| UPs de OIC de tesouraria | | | | | | |
| FEI CX F. MONETARIO | 66 492 | 5.49 | EUR | 5.49 | | 364 835 |
| OIC domiciliados num Estado-membro da EU | | | | | | 4 469 237 |
| UPs de OIC harmonizados | | | | | | |
| HSBC EURO GVT BOND F | 190 | 2 793.03 | EUR | 2 793.03 | | 530 676 |
| PETERCAM BdEUR InG-F | 19 945 | 57.09 | EUR | 57.09 | | 1 138 660 |
| BROCK EURO MKT Fd D2 | 35 572 | 20.28 | EUR | 20.28 | | 721 400 |
| BNPP L1 EQTY EURO I | 2 541 | 282.33 | EUR | 282.33 | | 717 401 |
| PIONEER EUROLND EQ I | 119 034 | 5.89 | EUR | 5.89 | | 701 110 |
| ROBECO EUR GOV BD I | 1 640 | 137.88 | EUR | 137.88 | | 226 123 |
| ALLIANZ EUROLND EQY G | 165 | 1 517.56 | EUR | 1 517.56 | | 250 397 |
| ISHARES EUROP MINVOL | 7 000 | 26.21 | EUR | 26.21 | | 183 470 |
| | | | | | | 4 469 237 |

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
Composição da Carteira em 2013-06-30

| Designação | Quantidade | Preço Unit. | Mda | Preço Unit. (EUR) | Juro Corrido (EUR) | Valor Total (EUR) |
|--|------------|-------------|-----|----------------------|-----------------------|----------------------|
| OIC domici. em Estados não membros da EU | | | | | | 49 343 |
| UPs de OIC | | | | | | |
| TISHMAN ESOFF | 91 579 | 0.54 | EUR | 0.54 | | 49 343 |
| | | | | | | 6 611 558 |

LIQUIDEZ

| | | | | | | |
|--|--|--|-----|--|--------|-----------|
| À vista | | | | | 73 | 73 |
| Depósitos à ordem | | | | | | |
| DO DO CGD - EUR 0.1130% | | | EUR | | 73 | 73 |
| A prazo | | | | | 28 473 | 1 703 473 |
| Depósitos com pré aviso e a prazo | | | | | | |
| DP DP CGD 10/10 359d 3.0000% 2012-10-10 a 2013-10-04 | | | EUR | | 9 900 | 459 900 |
| DP DP CGD 31/12 354d 3.0500% 2012-12-31 a 2013-12-20 | | | EUR | | 7 710 | 507 710 |
| DP DP CGD 21/12 364d 3.0500% 2012-12-21 a 2013-12-20 | | | EUR | | 3 253 | 203 253 |
| DP DP CGD 9/11 364d 3.1500% 2012-11-09 a 2013-11-08 | | | EUR | | 2 048 | 102 048 |
| DP DP CGD 28/12 357d 3.0500% 2012-12-28 a 2013-12-20 | | | EUR | | 1 567 | 101 567 |
| DP DP CGD 01/02 354d 2.9500% 2013-02-01 a 2014-01-21 | | | EUR | | 3 995 | 328 995 |
| | | | | | | 1 703 473 |
| | | | | | | 1 703 546 |

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

| | | | | | | |
|------------------|--|--|--|--|--|------------|
| Valores Activos | | | | | | 806 351 |
| Valores Passivos | | | | | | -151 570 |
| | | | | | | 654 781 |
| | | | | | | 41 020 183 |

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO

RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES

Em mercado regulamentado

Futuros

| | | | | | | |
|---------------------|----|----------|-----|----------|--|---------|
| VGU3-EUR EUX09/2013 | 15 | 2 593.00 | EUR | 2 593.00 | | 388 950 |
|---------------------|----|----------|-----|----------|--|---------|

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

3 432 419.98

Valor da Unidade de Participação 11.9508 €