

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

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.					1 918	89 676
Títulos de Dívida Pública						
OT 3.6% OUT/2014	31 000	100.15%	EUR	100.15%	792	31 837
Obrigações diversas						
SANTAN 3.25% 10/2014	50 000	101.28%	EUR	101.28%	1 126	51 768
Acções						
J.MARTINS-PO	375	16.19	EUR	16.19		6 071
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					20 999	3 832 280
Títulos de Dívida Pública						
DBR 6.25% 01/2024	35 000	143.08%	EUR	143.08%	1 067	51 143
DBR 4% 04/01/37	35 000	127.45%	EUR	127.45%	683	45 290
DBR 3.75% 01/2017	61 000	111.62%	EUR	111.62%	1 116	69 204
OBL 4% 10/2013	30 000	101.08%	EUR	101.08%	865	31 190
DBR 1.75% 07/04/22	38 000	101.55%	EUR	101.55%	809	39 396
FRTR 3.25% 25/4/2016	60 000	107.44%	EUR	107.44%	358	64 822
FRANCE O.A.T 4.25	26 000	113.55%	EUR	113.55%	754	30 276
FRTR 4.5% 04/2041	57 000	121.78%	EUR	121.78%	471	69 885
FRTR 3% 04/2022	86 000	106.81%	EUR	106.81%	474	92 326
SPGB 4.8% 01/2024	83 000	99.71%	EUR	99.71%	1 648	84 407
SPGB 5.5% 04/2021	57 000	107.35%	EUR	107.35%	533	61 719
BTPS 3.75% 12/2013	36 000	101.28%	EUR	101.28%	59	36 518
BTPS 5% 09/2040	48 000	99.81%	EUR	99.81%	796	48 702
BTPS 5% 03/2025	48 000	103.36%	EUR	103.36%	796	50 406
BTPS 3.75% 08/2016	115 000	103.18%	EUR	103.18%	1 787	120 444
BTPS 3% 11/2015	41 000	101.57%	EUR	101.57%	204	41 846
BTPS 5.5% 09/2022	78 000	107.54%	EUR	107.54%	1 422	85 300
NETHER 3.75% 01/23	74 000	115.34%	EUR	115.34%	1 270	86 618
BGB 3.5% 06/2017	97 000	109.16%	EUR	109.16%	28	105 908
RAGB 4.85 03/2026	40 000	127.13%	EUR	127.13%	574	51 426
RAGB 3.5% 07/2015	49 000	106.40%	EUR	106.40%	1 649	53 785
						1 320 611
Obrigações diversas						
CMZB Float 10/2013	30 000	100.45%	EUR	100.45%	95	30 230
CGD S.758 12/2017	650 000	75.22%	EUR	75.22%	452	489 355
CXGD 8% 09/2015	32 000	106.46%	EUR	106.46%	1 936	36 004
UAB S.11 10/2013	57 408	90.66%	EUR	90.66%	14	52 058
SANTAN Float 10/2013	50 000	100.32%	EUR	100.32%	145	50 305
LLOYDS BANK Float 16	10 000	95.78%	EUR	95.78%	23	9 601
BNP Float 12/2014	50 000	100.21%	EUR	100.21%	22	50 127
MS Float 04/2016	50 000	97.72%	EUR	97.72%	65	48 925
BAC Float 02/2014	50 000	99.87%	EUR	99.87%	27	49 963
Citigroup Flt.03/14	50 000	99.95%	EUR	99.95%	12	49 988
UBS Float 05/2014	20 000	100.40%	EUR	100.40%	18	20 099

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2013-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
DB Float 09/2016	15 000	96.69%	EUR	96.69%	5	14 508
KBC Float 07/13	50 000	100.07%	EUR	100.07%	189	50 222
GE Float 02/2016	25 000	99.31%	EUR	99.31%	10	24 836
ENELIM Float 01/2015	50 000	99.12%	EUR	99.12%	263	49 820
ENELIM Float 02/2016	30 000	98.00%	EUR	98.00%	113	29 514
BAVB Float 10/14	30 000	98.65%	EUR	98.65%	31	29 625
UCGIM Float 02/2014	30 000	99.66%	EUR	99.66%	17	29 916
UBIIM Float 07/2014	50 000	98.67%	EUR	98.67%	36	49 371
RABOBK Float 01/2014	10 000	100.34%	EUR	100.34%	19	10 054
BPCEGP Float 10/2013	50 000	100.24%	EUR	100.24%	88	50 209
ISPIM Float 12/2016	50 000	94.01%	EUR	94.01%	6	47 009
Intned Float 03/2016	15 000	94.93%	EUR	94.93%	5	14 244
Intned Float 04/2016	50 000	98.78%	EUR	98.78%	46	49 435
JPM Float 09/2013	50 000	100.05%	EUR	100.05%	3	50 027
						1 385 445
Acções						
DEUTSCHE BANK	511	32.16	EUR	32.16		16 431
SIEMENS	626	77.65	EUR	77.65		48 609
ALLIANZ	281	112.25	EUR	112.25		31 542
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 002	12.61	EUR	12.61		12 635
BASF	620	68.63	EUR	68.63		42 551
BAYER AG	414	81.93	EUR	81.93		33 919
MUNCHENER RUCKVERS.	107	141.40	EUR	141.40		15 130
ADIDAS- SALOMON AG	117	83.14	EUR	83.14		9 727
BEIERSDORF AG	292	67.00	EUR	67.00		19 564
HENKEL KGAA PREF.	259	72.25	EUR	72.25		18 713
SAP ORD.	472	56.26	EUR	56.26		26 555
FRESENIUS MEDICAL CA	219	54.53	EUR	54.53		11 942
DEUTSCHE BOERSE AG	157	50.57	EUR	50.57		7 939
VOLKSWAGEN AG-PREF.	197	155.55	EUR	155.55		30 643
GEN DES EAUX/VIVENDI	1 102	14.55	EUR	14.55		16 034
DANONE	404	57.66	EUR	57.66		23 295
AXA-UAP	489	15.10	EUR	15.10		7 381
CARREFOUR	256	21.13	EUR	21.13		5 409
TOTAL SA	1 099	37.51	EUR	37.51		41 218
Kering	42	156.15	EUR	156.15		6 558
BNP	673	41.98	EUR	41.98		28 249
AIR LIQUIDE	129	94.87	EUR	94.87		12 238
L.V.M.H.	81	124.50	EUR	124.50		10 085
MICHELIN	129	68.70	EUR	68.70		8 862
RENAULT SA	274	51.70	EUR	51.70		14 166
SOCIETE GENERALE	567	26.40	EUR	26.40		14 969
VALEO SA	326	48.29	EUR	48.29		15 741
GLE ENTREP. VINCI	789	38.56	EUR	38.56		30 420
SANOFI SYNHLABO	671	79.62	EUR	79.62		53 425
EADS	719	41.07	EUR	41.07		29 526

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2013-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
SUEZ ENVIRONNEMENT S	721	9.92	EUR	9.92		7 155
ARKEMA	112	70.53	EUR	70.53		7 899
EDF	275	17.84	EUR	17.84		4 905
BARCLAYS	3 092	2.78	GBP	3.25		10 044
WEIR GROUP PLC	240	21.51	GBP	25.09		6 022
FRESNILLO PLC	771	8.82	GBP	10.29		7 933
DE LA RUE PLC	269	9.67	GBP	11.28		3 033
AFREN PLC	5 626	1.30	GBP	1.51		8 499
ASHTREAD GROUP PLC	1 656	6.46	GBP	7.53		12 470
JAZZTEL PLC	1 357	5.97	EUR	5.97		8 101
BANCO POPULAR	3 680	2.36	EUR	2.36		8 666
TELEFONICA	2 648	9.85	EUR	9.85		26 070
BCO SANTANDER C.HISP	5 565	4.90	EUR	4.90		27 280
GAS NATURAL	494	15.49	EUR	15.49		7 652
IBERDROLA	2 683	4.06	EUR	4.06		10 882
REPSOL	883	16.21	EUR	16.21		14 313
BCO. BILBAO VISCAYA	2 570	6.45	EUR	6.45		16 564
FERROVIAL	1 487	12.28	EUR	12.28		18 260
INDITEX	124	94.84	EUR	94.84		11 760
TECNICAS REUNIDAS SA	251	35.30	EUR	35.30		8 859
DISTRIBINTERNACIONAL	1 074	5.81	EUR	5.81		6 240
UNICREDITO ITALIANO	1 589	3.60	EUR	3.60		5 717
ENI SPA	925	15.78	EUR	15.78		14 597
BANCA INTESA	9 419	1.23	EUR	1.23		11 595
TERNA SPA	2 316	3.19	EUR	3.19		7 393
AEGON NV	3 044	5.14	EUR	5.14		15 643
ING GROEP NV	3 338	7.00	EUR	7.00		23 366
UNILEVER NV-CVA	599	30.26	EUR	30.26		18 123
AKZO NOBEL NV NLG20	465	43.32	EUR	43.32		20 141
NOVO NORDISK AS	101	893.00	DKK	119.72		12 092
NOKIA A	7 805	2.85	EUR	2.85		22 213
UPM-KYMMENE	1 277	7.53	EUR	7.53		9 616
SAMPO OYJ-A SHS	246	29.94	EUR	29.94		7 365
SOLVAY SA	109	100.70	EUR	100.70		10 976
ANHEUSER-BUSCH INB	714	68.39	EUR	68.39		48 830
BELGACOM SA	858	17.24	EUR	17.24		14 788
OMV AG	219	34.70	EUR	34.70		7 599
						1 126 140
Direitos						
GROUP FNAC Dir.Inc	42	2.00	EUR	2.00		84
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU						41 670
Acções						
C.S.HOLD./GROUP-REG	347	25.05	CHF	20.30		7 045
C.FIN.RICHMONT	264	83.55	CHF	67.72		17 877
MARINE HARVEST	21 436	6.16	NOK	0.78		16 748
						41 670

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
						3 963 626
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC domiciliados em Portugal						788 853
Ups de OIC abertos						
CXG OB MAIS MENSAL	37 127	4.16	EUR	4.16		154 283
CXG IMOBILIARIO	53 412	3.25	EUR	3.25		173 813
F.LIMOB.IMOSOCIAL	16 827	6.33	EUR	6.33		106 466
IBERIA F.INV.IMOB	4 595	1.16	EUR	1.16		5 345
FUNDIESTAMO I	58	1 015.26	EUR	1 015.26		58 885
Fnd I.Imob. MAXIRENT	7 207	11.84	EUR	11.84		85 354
LOGISTICA E DISTRIB.	16 788	5.50	EUR	5.50		92 250
						676 397
Ups de OIC de tesouraria						
FEI CX F. MONETARIO	20 495	5.49	EUR	5.49		112 457
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						1 934 242
Ups de OIC harmonizados						
HSBC EURO GVT BOND F	66	2 793.03	EUR	2 793.03		184 340
PETERCAM BdEUR InG-F	5 100	57.09	EUR	57.09		291 159
BROCK EURO MKT Fd D2	17 523	20.28	EUR	20.28		355 366
BNPP L1 EQTY EURO I	1 229	282.33	EUR	282.33		346 984
PIONEER EUROLND EQ I	65 237	5.89	EUR	5.89		384 246
ROBECO EUR GOV BD I	770	137.88	EUR	137.88		106 168
ALLIANZ EUROLND EQY G	120	1 517.56	EUR	1 517.56		182 107
ISHARES EUROP MINVOL	3 200	26.21	EUR	26.21		83 872
						1 934 242
						2 723 095

LIQUIDEZ

À vista					11	11
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.1130%			EUR		11	11
A prazo					24 850	1 537 850
Depósitos com pré aviso e a prazo						
DP DP CGD 03/07 365d 3.7500% 2012-07-03 a 2013-07-03			EUR		7 563	207 563
DP DP CGD 01/02 354d 2.9500% 2013-02-01 a 2014-01-21			EUR		897	73 897
DP DP CGD 27/06 363d 2.7500% 2013-06-27 a 2014-06-25			EUR		76	250 076
DP DP CGD 28/9 368d 2.9000% 2012-09-28 a 2013-10-01			EUR		2 223	102 223
DP DP CGD 30-10 395d 3.1500% 2012-10-30 a 2013-11-29			EUR		641	30 641
DP DP CGD 28/03 391d 3.0000% 2013-03-28 a 2014-04-23			EUR		1 267	161 267
DP DP CGD 21/12 364d 3.0500% 2012-12-21 a 2013-12-20			EUR		7 727	482 727
DP DP CGD 10/10 359d 3.0000% 2012-10-10 a 2013-10-04			EUR		3 300	153 300
DP DP CGD 31/12 354d 3.0500% 2012-12-31 a 2013-12-20			EUR		1 156	76 156

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
Valores Activos						86 145
Valores Passivos						-26 314
						59 832
						8 284 413
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
VGU3-EUR EUX09/2013	5	2 593.00	EUR	2 593.00		129 650
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					1 582 651.03	

Valor da Unidade de Participação 5.2345 €