

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
 Composição da Carteira em 2014-12-31

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.					321 306	22 144 827
Títulos de Dívida Pública						
OT 4.95% 10/2023	750 000	114.04%	EUR	114.04%	6 916	862 254
OT 5.65% 02/2024	2 000 000	118.02%	EUR	118.02%	99 068	2 459 466
OT 4.8% 06/2020	750 000	113.38%	EUR	113.38%	19 726	870 109
OT 3.85% 04/2021	750 000	108.33%	EUR	108.33%	20 648	833 119
OT 4.75% 06/2019	750 000	113.96%	EUR	113.96%	19 618	874 314
						5 899 262
Obrigações diversas						
CXGD 3% 01/2019	600 000	99.56%	EUR	99.56%	17 310	614 650
VERSE 2 SNR 02/2018	1 668 359	100.00%	EUR	100.00%	2 072	1 670 393
TAGST 09-ENG Y A1/25	1 082 909	97.30%	EUR	97.30%	1 186	1 054 857
CXGD 4.25% 01/2020	1 000 000	105.96%	EUR	105.96%	39 473	1 099 045
BPIPL 3.25% 01/2015	1 400 000	100.01%	EUR	100.01%	43 755	1 443 901
CXGD 3.75% 01/2018	1 000 000	99.88%	EUR	99.88%	35 753	1 034 560
VERSE 1 SNR 02/2017	9 078 161	102.58%	EUR	102.58%	15 781	9 328 159
						16 245 566
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					304 658	20 685 012
Títulos de Dívida Pública						
SPGB 4.6% 07/2019	500 000	116.59%	EUR	116.59%	9 767	592 707
SPGB 4.3% 10/2019	500 000	115.91%	EUR	115.91%	3 652	583 181
SPGB 3.75% 10/2015	250 000	100.65%	EUR	100.65%	1 592	253 206
BTPS 4.25% 2/2019	375 000	113.27%	EUR	113.27%	6 626	431 394
BTPS 4.5% 08/2018	375 000	112.78%	EUR	112.78%	7 016	429 941
BTPS 4.5% 03/2019	375 000	114.91%	EUR	114.91%	5 687	436 592
BTPS 3.5% 06/2018	375 000	108.89%	EUR	108.89%	1 118	409 460
BGB Float 02/2016	350 000	100.73%	EUR	100.73%	297	352 852
CCTS Float 11/18	230 000	103.83%	EUR	103.83%	775	239 584
						3 728 918
Obrigações diversas						
CAJAMM 4.375%11/15	500 000	100.10%	EUR	100.10%	1 884	502 392
SANTAN 3.5% 03/2015	250 000	100.16%	EUR	100.16%	7 120	257 532
BBVASM 4.375% 9/2015	1 000 000	99.97%	EUR	99.97%	12 226	1 011 930
BANEST 3.5% 01/2015	700 000	100.04%	EUR	100.04%	22 755	723 040
SANTAN 2.875% 01/18	500 000	99.53%	EUR	99.53%	13 233	510 869
ISPIM 4.125% 01/2016	300 000	101.12%	EUR	101.12%	11 934	315 280
ISPIM 4.125% 09/2016	500 000	99.83%	EUR	99.83%	5 877	505 005
GS 4% 02/2015	1 500 000	100.27%	EUR	100.27%	54 740	1 558 821
GE 2.875% 06/2019	1 000 000	103.60%	EUR	103.60%	15 517	1 051 553
BESPL 2.625% 05/2017	7 000 000	100.85%	EUR	100.85%	119 815	7 179 278
BACR Float 03/2021	900 000	88.25%	EUR	88.25%	137	794 387
Santander Flt.07/17	150 000	99.44%	EUR	99.44%	264	149 420
MS Float 04/2016	225 000	100.13%	EUR	100.13%	237	225 520

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2014-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
GSFloat 10/2019	50 000	100.21%	EUR	100.21%	74	50 180
C Float 11/2019	100 000	99.79%	EUR	99.79%	89	99 882
WSTP Float 03/2017	250 000	100.35%	EUR	100.35%	74	250 946
TELEFO Float 03/2016	300 000	100.16%	EUR	100.16%	18	300 483
HBOS Float 03/2017	150 000	99.21%	EUR	99.21%	32	148 851
RY Float 03/2019	300 000	100.65%	EUR	100.65%	13	301 969
ABNANV Float 03/2019	100 000	101.92%	EUR	101.92%	59	101 979
ENIIMFloat 10/2017	200 000	106.58%	EUR	106.58%	1 324	214 482
CAT Float 09/2017	200 000	100.29%	EUR	100.29%	7	200 580
UCGIM Float 01/2016	200 000	100.87%	EUR	100.87%	624	202 370
RABOBK Float 09/2017	200 000	99.23%	EUR	99.23%	5	198 465
BPCEGP Float 05/2018	100 000	100.81%	EUR	100.81%	70	100 879
						16 956 094
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					55	100 133
Obrigações diversas						
AT&T Flt 06/19	100 000	100.08%	EUR	100.08%	55	100 133
						42 929 972

LIQUIDEZ

À vista						1 650 583
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.0160%			EUR		145	1 650 583
						1 650 583
A prazo					2 201 306	272 541 587
Depósitos com pré aviso e a prazo						
DP DP CGD 14/3 364D 2.4845% 2014-06-12 a 2015-03-13			EUR		457 384	33 105 166
DP DP CGD 24/11 365D 1.2000% 2014-11-24 a 2015-11-24			EUR		44 333	35 044 333
DP DP CGD 08/08 364d 1.8000% 2014-08-08 a 2015-08-07			EUR		248 200	34 248 200
DP DP CGD 11/06 365d 2.1000% 2014-06-11 a 2015-06-11			EUR		70 627	6 005 627
DP DP CGD 25/11 364D 1.2000% 2014-11-25 a 2015-11-24			EUR		19 302	15 669 302
DP DP CGD 23/12 365D 1.0000% 2014-12-23 a 2015-12-23			EUR		7 750	31 007 750
DP DP CGD 18/03 360d 2.5000% 2014-03-18 a 2015-03-13			EUR		100 347	5 100 347
DP DP CGD 30/4 358d 2.4000% 2014-04-30 a 2015-04-23			EUR		49 200	3 049 200
DP DP CGD 25/08 365d 1.7000% 2014-08-25 a 2015-08-25			EUR		30 458	5 030 458
DP DP CGD 26/09 364D 1.2000% 2014-09-26 a 2015-09-25			EUR		42 033	13 042 033
DP DP CGD 23/4 365d 2.4000% 2014-04-23 a 2015-04-23			EUR		503 217	30 338 217
DP DP CGD 25/6 365d 2.0000% 2014-06-25 a 2015-06-25			EUR		142 500	13 642 500
DP DP CGD 31/12 365d 1.0000% 2014-12-31 a 2015-12-31			EUR		101	3 650 101
DP DP CGD 8/MAIO 350d 2.3500% 2014-05-08 a 2015-04-23			EUR		93 217	6 093 217
DP DP CGD 14/10 365D 1.2000% 2014-10-14 a 2015-10-14			EUR		20 935	7 970 935
DP DP CGD 3/10 357D 1.2000% 2014-10-03 a 2015-09-25			EUR		27 000	9 027 000
DP DP CGD 21JAN 365d 2.5000% 2014-01-21 a 2015-01-21			EUR		198 639	8 489 639
DP DP CGD 04/02 365d 2.5000% 2014-02-04 a 2015-02-04			EUR		131 021	5 831 021
DP DP CGD 20/10 365D 1.2000% 2014-10-20 a 2015-10-20			EUR		15 042	6 196 542
						272 541 587

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2014-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
						274 192 170
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
Valores Activos						22 320
Valores Passivos						-356 078
						-333 758
						316 788 384
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					53 859 790.69	

Valor da Unidade de Participação: € 5.8817