

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

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.					19 662	997 655
Títulos de Dívida Pública						
OT 3.6% OUT/2014	172 000	99.67%	EUR	99.67%	5 446	176 869
Obrigações diversas						
CXGD 3.625% 07/2014	200 000	100.52%	EUR	100.52%	834	201 874
SANTAN 3.25% 10/2014	150 000	100.98%	EUR	100.98%	4 207	155 673
BESPL 3.375% 02/15	250 000	99.57%	EUR	99.57%	4 531	253 451
CXGD 3.75% 01/2018	200 000	98.89%	EUR	98.89%	4 644	202 414
						813 412
Acções						
J.MARTINS-PO	502	14.69	EUR	14.69		7 374
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					115 384	23 541 970
Títulos de Dívida Pública						
DBR 6.25% 01/2024	80 000	140.94%	EUR	140.94%	3 288	116 040
DBR 4% 04/01/37	156 000	123.75%	EUR	123.75%	4 103	197 145
DBR 3.75% 01/2017	104 000	110.92%	EUR	110.92%	2 564	117 921
DBR 1.75% 07/04/22	63 000	100.62%	EUR	100.62%	178	63 569
DBR 1.5% 05/2023	98 000	96.87%	EUR	96.87%	439	95 367
FRTR 3.25% 25/4/2016	134 000	107.12%	EUR	107.12%	1 539	145 073
FRANCE O.A.T 4.25	60 000	113.01%	EUR	113.01%	2 173	69 976
FRTR 4.5% 04/2041	238 000	118.50%	EUR	118.50%	3 785	285 803
FRTR 3% 04/2022	434 000	106.03%	EUR	106.03%	4 602	464 772
SPGB 4.8% 01/2024	216 000	101.60%	EUR	101.60%	6 050	225 506
SPGB 3.15% 01/2016	90 000	101.85%	EUR	101.85%	1 654	93 315
SPGB 5.5% 04/2021	310 000	109.01%	EUR	109.01%	5 792	343 723
SPGB 3.3% 10/2014	37 000	102.06%	EUR	102.06%	1 020	38 782
BTPS 4.25% 09/2019	60 000	103.80%	EUR	103.80%	1 275	63 552
BTPS 5% 09/2040	213 000	99.57%	EUR	99.57%	5 325	217 398
BTPS 5% 03/2025	213 000	104.20%	EUR	104.20%	5 325	227 271
BTPS 3.75% 08/2016	580 000	103.71%	EUR	103.71%	1 832	603 321
BTPS 3% 11/2015	364 000	102.10%	EUR	102.10%	3 650	375 294
BTPS 5.5% 09/2022	185 000	108.53%	EUR	108.53%	5 088	205 859
NETHER 3.75% 01/23	337 000	113.56%	EUR	113.56%	7 929	390 609
BGB 3.5% 06/2017	468 000	108.86%	EUR	108.86%	2 917	512 358
RAGB 4.85 03/2026	168 000	124.95%	EUR	124.95%	3 795	213 711
CCTS Float 06/15/17	400 000	101.39%	EUR	101.39%	2 444	408 004
						5 474 370
Obrigações diversas						
BCPN Float 05/14	600 000	96.95%	EUR	96.95%	145	581 845

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ITFIN 2005-1 A2/20	5 502	98.85%	EUR	98.85%	4	5 443
BMW Float 09/2016	100 000	99.99%	EUR	99.99%		99 985
NDASS 2.25% 05/2019	100 000	103.65%	EUR	103.65%	746	104 396
MAGEL 4 D 07/2059	126 478	36.00%	EUR	36.00%	111	45 643
CGD S.758 12/2017	4 050 000	78.83%	EUR	78.83%	15 296	3 208 113
CAFP Float 04/2016	300 000	100.50%	EUR	100.50%	419	301 907
SANT.CONS.FIN.Flt 16	250 000	89.25%	EUR	89.25%	484	223 609
SANTAN Float 09/2016	600 000	98.94%	EUR	98.94%	1 974	595 590
LLOYDS BANK Float 16	250 000	97.44%	EUR	97.44%	381	243 976
BNP Float 12/2014	130 000	100.21%	EUR	100.21%	187	130 460
HSBC Float 09/2020	200 000	96.92%	EUR	96.92%	189	194 023
MS Float 04/2016	580 000	98.64%	EUR	98.64%	478	572 590
Citigroup Flt.03/14	400 000	99.99%	EUR	99.99%	332	400 280
UBS Float 05/2014	300 000	100.30%	EUR	100.30%	97	300 988
TELEFO Float 06/2015	750 000	101.20%	EUR	101.20%	3 797	762 767
SOCGEN Float 01/2015	500 000	100.32%	EUR	100.32%	445	502 040
VLVY Float 05/2016	350 000	100.28%	EUR	100.28%	160	351 143
DB Float 09/2016	400 000	97.83%	EUR	97.83%	819	392 119
NYKRE Float 01/2014	200 000	100.63%	EUR	100.63%	390	201 656
DAIGR Float 04/2015	500 000	99.90%	EUR	99.90%	329	499 827
SYDBDC Float 02/2014	100 000	100.70%	EUR	100.70%	24	100 724
GE Float 02/2016	600 000	99.23%	EUR	99.23%	63	595 461
AYTCED Float 11/2015	600 000	95.77%	EUR	95.77%	190	574 816
ENELIM Float 01/2015	400 000	99.79%	EUR	99.79%	603	399 767
ENIIM Float 10/2017	415 000	107.29%	EUR	107.29%	5 156	450 414
BAVB Float 10/14	50 000	98.99%	EUR	98.99%	36	49 529
JYBC Float 05/2015	300 000	101.13%	EUR	101.13%	133	303 511
UCGIM Float 01/2016	600 000	99.77%	EUR	99.77%	1 175	599 807
UCGIM Float 07/2015	200 000	99.95%	EUR	99.95%	384	200 288
UBIIM Float 07/2014	500 000	99.19%	EUR	99.19%	215	496 170
UBIIM Float 12/2014	300 000	99.21%	EUR	99.21%	890	298 505
RABOBK Float 04/2015	100 000	100.06%	EUR	100.06%	48	100 107
ACAFP Float 01/2015	200 000	100.22%	EUR	100.22%	165	200 597
LANISL Float 05/2012	200 000	8.00%	EUR	8.00%		16 000
BPCEGP Float 12/2014	400 000	100.16%	EUR	100.16%	636	401 256
ISPIM Float 07/2015	800 000	100.24%	EUR	100.24%	1 303	803 255
Intned Float 04/2016	400 000	98.89%	EUR	98.89%	241	395 809
INTNED Float 11/2014	500 000	100.35%	EUR	100.35%	40	501 800
DANBNK Float 03/2014	200 000	100.45%	EUR	100.45%	536	201 434
						16 407 645
Acções						
BMW	520	71.29	EUR	71.29		37 071
DEUTSCHE BANK	1 055	32.76	EUR	32.76		34 562
SIEMENS	913	80.09	EUR	80.09		73 122
ALLIANZ	399	108.40	EUR	108.40		43 252
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 375	11.98	EUR	11.98		16 473
BASF	882	66.13	EUR	66.13		58 327

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BAYER AG	600	84.04	EUR	84.04		50 424
MUNCHENER RUCKVERS.	174	137.90	EUR	137.90		23 995
ADIDAS- SALOMON AG	372	80.00	EUR	80.00		29 760
BEIERSDORF AG	415	65.20	EUR	65.20		27 058
HENKEL KGAA PREF.	371	73.30	EUR	73.30		27 194
SAP ORD.	577	55.93	EUR	55.93		32 272
THYSSEN KRUPP	1 198	15.91	EUR	15.91		19 054
FRESENIUS MEDICAL CA	245	49.19	EUR	49.19		12 050
VOLKSWAGEN AG-PREF.	274	172.10	EUR	172.10		47 155
OSRAM LICHT AG	91	30.38	EUR	30.38		2 765
GEN DES EAUX/VIVENDI	1 193	15.35	EUR	15.35		18 307
DANONE	575	56.34	EUR	56.34		32 396
AXA-UAP	695	16.49	EUR	16.49		11 457
CARREFOUR	364	23.69	EUR	23.69		8 621
TOTAL SA	1 261	41.92	EUR	41.92		52 855
Kering	59	170.90	EUR	170.90		10 083
BNP	965	47.42	EUR	47.42		45 755
AIR LIQUIDE	145	99.51	EUR	99.51		14 429
L.V.M.H.	116	132.55	EUR	132.55		15 376
MICHELIN	184	72.39	EUR	72.39		13 320
RENAULT SA	389	54.08	EUR	54.08		21 037
SOCIETE GENERALE	1 035	33.12	EUR	33.12		34 274
GLE ENTREP. VINCI	999	39.07	EUR	39.07		39 031
SANOFI SYNHLABO	968	72.69	EUR	72.69		70 364
EADS	828	43.61	EUR	43.61		36 105
SUEZ ENVIRONNEMENT S	1 349	11.28	EUR	11.28		15 210
EDF	429	21.20	EUR	21.20		9 095
LLOYDS BANK	12 121	0.73	GBP	0.85		10 298
BARCLAYS	5 331	2.83	GBP	3.32		17 689
WEIR GROUP PLC	357	21.75	GBP	25.47		9 093
DE LA RUE PLC	384	9.96	GBP	11.66		4 477
AFREN PLC	13 999	1.39	GBP	1.63		22 819
ASHTREAD GROUP PLC	2 107	6.45	GBP	7.55		15 914
JAZZTEL PLC	1 931	6.87	EUR	6.87		13 266
BANCO POPULAR	4 843	3.55	EUR	3.55		17 207
TELEFONICA	3 837	10.28	EUR	10.28		39 425
BCO SANTANDER C.HISP	9 224	5.34	EUR	5.34		49 256
GAS NATURAL	703	14.82	EUR	14.82		10 418
IBERDROLA	3 815	4.01	EUR	4.01		15 306
REPSOL	1 359	17.56	EUR	17.56		23 857
BCO. BILBAO VISCAYA	2 957	7.22	EUR	7.22		21 350
FERROVIAL	2 043	12.55	EUR	12.55		25 640
DISTRINTERNACIONAL	1 527	5.98	EUR	5.98		9 131
UNICREDITO ITALIANO	2 279	4.28	EUR	4.28		9 750
BANCA INTESA	7 034	1.49	EUR	1.49		10 445
FINMECCANICA	2 450	3.87	EUR	3.87		9 482
TERNA SPA	3 325	3.23	EUR	3.23		10 746

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2013-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
AEGON NV	4 360	5.40	EUR	5.40		23 527
ING GROEP NV	4 018	8.22	EUR	8.22		33 008
UNILEVER NV-CVA	858	28.43	EUR	28.43		24 389
ASML NA	311	66.31	EUR	66.31		20 622
AKZO NOBEL NV NLG20	665	44.50	EUR	44.50		29 589
SBM OFFSHORE NV	1 404	14.87	EUR	14.87		20 870
NOKIA A	4 762	2.93	EUR	2.93		13 934
UPM-KYMMENE	2 906	9.14	EUR	9.14		26 546
Neste Oil Oyj	1 587	13.90	EUR	13.90		22 059
SOLVAY SA	154	105.40	EUR	105.40		16 232
ANHEUSER-BUSCH INB	956	70.38	EUR	70.38		67 283
BELGACOM SA	1 219	18.10	EUR	18.10		22 064
OMV AG	344	34.93	EUR	34.93		12 016
						1 659 955
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU						76 897
Acções						
NOVARTIS REG	320	67.85	CHF	55.12		17 638
C.S.HOLD./GROUP-REG	493	26.82	CHF	21.79		10 741
C.FIN.RICHMONT	377	88.40	CHF	71.81		27 073
MARINE HARVEST	30 520	5.69	NOK	0.70		21 446
						76 897
						24 616 523
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC domiciliados em Portugal						3 155 373
UPs de OIC abertos						
CXG OB MAIS MENSAL	415 859	4.18	EUR	4.18		1 738 373
FEI CX F. MONETARIO	136 489	5.50	EUR	5.50		750 637
CXG LIQUIDEZ	126 728	5.26	EUR	5.26		666 362
						3 155 373
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						4 608 122
UPs de OIC harmonizados						
HSBC EURO GVT BOND F	190	2 802.36	EUR	2 802.36		532 448
PETERCAM BdEUR InG-F	19 945	57.19	EUR	57.19		1 140 655
BROCK EURO MKT Fd D2	35 572	21.40	EUR	21.40		761 241
BNPP L1 EQTY EURO I	2 541	298.07	EUR	298.07		757 396
PIONEER EUROLND EQ I	119 034	6.24	EUR	6.24		742 772
ROBECO EUR GOV BD I	1 640	138.37	EUR	138.37		226 927
ALLIANZ EUROLND EQY G	165	1 560.02	EUR	1 560.02		257 403
ISHARES EUROP MINVOL	7 000	27.04	EUR	27.04		189 280
						4 608 122
OIC domici. em Estados não membros da EU						49 860
UPs de OIC						
TISHMAN ESOF	91 579	0.54	EUR	0.54		49 860

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
						7 813 355
LIQUIDEZ						
À vista					58	58
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - EUR 0.1048%			EUR		58	58
A prazo					37 194	1 712 194
Depósitos com pré aviso e a prazo						
DP DP CGD 10/10 359d 3.0000% 2012-10-10 a 2013-10-04			EUR		12 225	462 225
DP DP CGD 31/12 354d 3.0500% 2012-12-31 a 2013-12-20			EUR		10 336	510 336
DP DP CGD 21/12 364d 3.0500% 2012-12-21 a 2013-12-20			EUR		4 304	204 304
DP DP CGD 9/11 364d 3.1500% 2012-11-09 a 2013-11-08			EUR		2 590	102 590
DP DP CGD 28/12 357d 3.0500% 2012-12-28 a 2013-12-20			EUR		2 093	102 093
DP DP CGD 01/02 354d 2.9500% 2013-02-01 a 2014-01-21			EUR		5 646	330 646
						1 712 194
						1 712 252
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
Valores Activos						672 733
Valores Passivos						-212 244
						460 489
						42 003 619
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
VGU3-EUR EUX09/2013	9	2 721.00	EUR	2 721.00		244 890
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					3 470 287.86	

Valor da Unidade de Participação 12.1038 €