

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

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.					198 569	5 638 832
Títulos de Dívida Pública						
OT 3.6% OUT/2014	40 000	99.87%	EUR	99.87%	1 266	41 213
OT 5.45% Set. 2013	2 650 000	100.08%	EUR	100.08%	135 720	2 787 766
						2 828 979
Obrigações diversas						
SANTAN 3.25% 10/2014	350 000	98.59%	EUR	98.59%	9 817	354 894
BPIPL 3.25% 01/2015	1 400 000	100.35%	EUR	100.35%	28 547	1 433 456
CXGD 3.75% 01/2018	1 000 000	99.83%	EUR	99.83%	23 219	1 021 504
						2 809 854
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					285 890	17 599 471
Títulos de Dívida Pública						
BTNS 2.5% 01/2014	46 000	100.48%	EUR	100.48%	731	46 950
SPGB 3.75% 10/2015	250 000	101.68%	EUR	101.68%	7 834	262 033
BTPS 3.75% 12/2013	82 000	100.39%	EUR	100.39%	655	82 974
CCTS Float 06/15/17	230 000	101.39%	EUR	101.39%	1 405	234 602
CCTS Float 12/15	600 000	98.58%	EUR	98.58%	1 456	592 936
BGB Float 02/2016	350 000	101.08%	EUR	101.08%	136	353 909
						1 573 403
Obrigações diversas						
ACACB 3.5% 07/2014	2 000 000	100.63%	EUR	100.63%	8 055	2 020 707
CAIX.GALI 3% 11/2014	1 000 000	99.56%	EUR	99.56%	24 822	1 020 415
CAJAMM 4.375%11/15	500 000	100.25%	EUR	100.25%	16 467	517 715
SANTAN 3.5% 03/2015	250 000	101.33%	EUR	101.33%	4 195	257 517
BBVASM 4.375% 9/2015	1 000 000	99.92%	EUR	99.92%	41 353	1 040 510
BANEST 3.5% 01/2015	700 000	100.77%	EUR	100.77%	14 566	719 988
SANTAN 2.875% 01/18	500 000	99.32%	EUR	99.32%	8 428	505 042
BPIM 3.875% 03/2014	2 500 000	99.98%	EUR	99.98%	40 873	2 540 338
ISPIM 4.125% 01/2016	300 000	102.55%	EUR	102.55%	7 798	315 443
ISPIM 4.125% 09/2016	500 000	99.69%	EUR	99.69%	19 608	518 059
MER.LYNCH 4.625% /13	705 000	100.12%	EUR	100.12%	29 837	735 680
GS 4% 02/2015	1 500 000	104.29%	EUR	104.29%	34 685	1 599 002
BMW Float 09/2016	200 000	99.99%	EUR	99.99%		199 970
GE CAP 4.625% 07/14	500 000	101.16%	EUR	101.16%	3 738	509 544
GE 2.875% 06/2019	1 000 000	104.68%	EUR	104.68%	5 908	1 052 710
CXGD 5.125% 02/2014	300 000	100.70%	EUR	100.70%	8 172	310 273
BNP Float 12/2014	100 000	100.21%	EUR	100.21%	144	100 354
MS Float 04/2016	225 000	98.64%	EUR	98.64%	185	222 125
BAC Float 05/2016	100 000	98.83%	EUR	98.83%	15	98 842
TELEFO Float 06/2015	300 000	101.20%	EUR	101.20%	1 519	305 107
SOCGEN Float 01/2015	100 000	100.32%	EUR	100.32%	89	100 408
GE Float 02/2016	300 000	99.23%	EUR	99.23%	31	297 730
ENIIMFloat 10/2017	200 000	107.29%	EUR	107.29%	2 485	217 067

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2013-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
BAVB Float 10/14	35 000	98.99%	EUR	98.99%	25	34 670
UCGIM Float 02/2014	35 000	99.79%	EUR	99.79%	10	34 936
UCGIM Float 01/2016	200 000	99.77%	EUR	99.77%	392	199 936
RABOBK Float 01/2014	200 000	100.24%	EUR	100.24%	245	200 719
INTNED Float 11/2014	350 000	100.35%	EUR	100.35%	28	351 260
						16 026 068
						23 238 304

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						4 521 540
UPs de OIC abertos						
CXGEST ACTIVOS CP	34 995	10.81	EUR	10.81		378 298
FEI CX F. MONETARIO	188 852	5.50	EUR	5.50		1 038 612
CXG LIQUIDEZ	590 436	5.26	EUR	5.26		3 104 629
						4 521 540
						4 521 540

LIQUIDEZ

À vista					151	151
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.1048%			EUR		151	151
A prazo					402 326	32 417 326
Depósitos com pré aviso e a prazo						
DP DP CGD 21/04 393d 3.0000% 2013-04-22 a 2014-05-20			EUR		22 000	2 022 000
DP DP CGD 4/7 368d 2.7500% 2013-07-04 a 2014-07-07			EUR		9 014	2 009 014
DP DP CGD 27/06 363d 2.7500% 2013-06-27 a 2014-06-25			EUR		38 317	7 638 317
DP DP CGD 28/9 368d 2.9000% 2012-09-28 a 2013-10-01			EUR		40 842	1 540 842
DP DP CGD 21/12 364d 3.0500% 2012-12-21 a 2013-12-20			EUR		88 337	4 193 337
DP DP CGD 30/01 356d 2.9500% 2013-01-30 a 2014-01-21			EUR		10 522	610 522
DP DP CGD 30-10 395d 3.1500% 2012-10-30 a 2013-11-29			EUR		13 388	513 388
DP DP CGD 28/03 391d 3.0000% 2013-03-28 a 2014-04-23			EUR		65 417	5 065 417
DP DP CGD 31/12 354d 3.0500% 2012-12-31 a 2013-12-20			EUR		12 610	622 610
DP DP CGD 10/10 359d 3.0000% 2012-10-10 a 2013-10-04			EUR		70 633	2 670 633
DP DP CGD 29/07 365d 2.7500% 2013-07-29 a 2014-07-29			EUR		11 688	4 511 688
DP DP CGD 01/03 378d 3.0000% 2013-03-01 a 2014-03-14			EUR		9 200	609 200
DP DP CGD 9/11 364d 3.1500% 2012-11-09 a 2013-11-08			EUR		10 360	410 360
						32 417 326
						32 417 477

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						1 206 840
Valores Passivos						-247 685
						959 155
						61 136 475

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2013-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					10 672 904.73	

Valor da Unidade de Participação 5.7282 €