

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
 Composição da Carteira em 2017-12-31

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.					195 690	10 716 638
Títulos de Dívida Pública						
OT 4.8% 06/2020	1 250 000	111.73%	EUR	111.73%	32 877	1 429 439
OT 3.85% 04/2021	1 750 000	112.42%	EUR	112.42%	48 178	2 015 580
OT 4.75% 06/2019	2 000 000	107.02%	EUR	107.02%	52 315	2 192 635
						5 637 655
Obrigações diversas						
CXGD 3% 01/2019	600 000	103.22%	EUR	103.22%	17 310	636 624
VERSE 2 SNR 02/2018	215 691	100.17%	EUR	100.17%	249	216 298
TAGST 09-ENGY A1/25	785 043	102.07%	EUR	102.07%	691	801 993
CXGD 1% 01/2022	700 000	101.93%	EUR	101.93%	6 501	719 983
VERSE 3 SNR 02/2019	1 249 823	100.79%	EUR	100.79%	1 313	1 260 997
VERSE 4 SNR 02/2021	394 081	102.83%	EUR	102.83%	504	405 725
CXGD 3.75% 01/2018	1 000 000	100.16%	EUR	100.16%	35 753	1 037 363
						5 078 984
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					1 545 782	169 889 047
Títulos de Dívida Pública						
FADE 0.031% 06/2020	5 400 000	100.15%	EUR	100.15%	913	5 408 851
Obrigações diversas						
RENEPL 4.125% 01/18	500 000	100.18%	EUR	100.18%	18 930	519 835
DAIGR Float 07/24	1 000 000	100.68%	EUR	100.68%	303	1 007 113
VW Float 07/19	1 100 000	100.16%	EUR	100.16%	56	1 101 761
BASGR Float 11/19	1 300 000	100.51%	EUR	100.51%		1 306 617
COFP 4.481% 11/2018	6 000 000	104.75%	EUR	104.75%	47 104	6 332 344
LGFP 5.375% 11/2018	5 000 000	104.70%	EUR	104.70%	24 298	5 259 098
MWDP 6.75% 04/2018	4 000 000	101.95%	EUR	101.95%	189 370	4 267 330
COFP 3.994 03/2020	1 000 000	110.41%	EUR	110.41%	32 609	1 136 699
PPFP 3.125% 04/2019	1 200 000	104.15%	EUR	104.15%	25 993	1 275 745
RENAUL 1.125% 09/19	1 200 000	101.97%	EUR	101.97%	3 440	1 227 032
MCFP 1% 09/2021	1 400 000	102.93%	EUR	102.93%	3 797	1 444 789
BPCEGP 5.1% 06/2018	1 480 000	102.55%	EUR	102.55%	1 048	1 518 855
RENAUL 3.625% 09/18	2 000 000	102.62%	EUR	102.62%	20 658	2 073 138
KERFP 1.875% 10/2018	1 500 000	101.56%	EUR	101.56%	6 550	1 530 010
BPCEGP 3.7% 05/2018	2 530 000	101.42%	EUR	101.42%	12 210	2 578 073
BNFP Float 11/18	400 000	100.18%	EUR	100.18%		400 700
RENAULT Float 08/20	100 000	100.43%	EUR	100.43%	28	100 456
BPCEGP Float 03/22	500 000	103.11%	EUR	103.11%	211	515 741
RENAULT Float 04/21	100 000	100.92%	EUR	100.92%	72	100 987
ACAFP Float 04/22	1 000 000	102.09%	EUR	102.09%	955	1 021 855
MCFP 0% 05/20	4 300 000	100.04%	EUR	100.04%		4 301 677
MCFP Float 11/18	465 000	100.24%	EUR	100.24%		466 121
BNP Float 06/24	800 000	102.29%	EUR	102.29%	236	818 556
RENAUL Float 03/2022	400 000	101.21%	EUR	101.21%	69	404 897

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2017-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
GFCFP Float 06/22	800 000	100.29%	EUR	100.29%	3	802 307
ALDFP Float 11/20	500 000	100.49%	EUR	100.49%	49	502 487
ABBEY 2.625% 07/2020	750 000	106.33%	EUR	106.33%	9 116	806 621
LLOYDS 1.875% 10/18	1 500 000	101.61%	EUR	101.61%	6 396	1 530 471
ABBEY 2% 01/2019	1 000 000	102.15%	EUR	102.15%	19 288	1 040 738
DGELN 1.125% 05/2019	1 000 000	101.57%	EUR	101.57%	6 966	1 022 656
F 1.75% 05/18	5 000 000	100.70%	EUR	100.70%	53 938	5 088 888
ABBEY 0.875% 01/2020	500 000	101.72%	EUR	101.72%	4 231	512 841
LLOYDS 0.625% 04/20	1 500 000	101.42%	EUR	101.42%	6 575	1 527 830
HSBC Float 09/22	750 000	101.58%	EUR	101.58%	39	761 874
F Float 08/20	300 000	100.52%	EUR	100.52%	50	301 619
WPPLN Float 05/20	800 000	100.32%	EUR	100.32%		802 520
SANUK Float 05/23	500 000	101.81%	EUR	101.81%	263	509 323
RBS Float 06/20	900 000	100.55%	EUR	100.55%	62	905 039
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	102.30%	EUR	102.30%	138	1 023 098
HSBC 0.17% 10/23	500 000	100.67%	EUR	100.67%	208	503 558
TELEFO 4.693% 11/19	1 000 000	108.74%	EUR	108.74%	6 557	1 093 997
REDELE 4.875% 04/202	1 000 000	111.37%	EUR	111.37%	32 990	1 146 720
TELEFO 4.797 02/2018	5 000 000	100.62%	EUR	100.62%	206 337	5 237 537
CABKSM 3.125% 05/18	4 000 000	101.14%	EUR	101.14%	79 452	4 124 892
SANTAN 1.1% 07/2018	2 000 000	100.74%	EUR	100.74%	9 403	2 024 103
SANSCF Float 01/19	600 000	100.25%	EUR	100.25%	165	601 689
IBESM Float 02/24	1 100 000	101.00%	EUR	101.00%	438	1 111 454
SANTAN Float 03/22	600 000	102.17%	EUR	102.17%	127	613 153
BBVASM Float 04/22	1 200 000	101.17%	EUR	101.17%	732	1 214 796
CRUNAV Float 06/2022	500 000	99.47%	EUR	99.47%	49	497 379
VLVY 2.375% 11/26/19	250 000	104.52%	EUR	104.52%	586	261 896
SCANIA Float 10/18	500 000	100.19%	EUR	100.19%	20	500 950
SCANIA Float 04/20	500 000	100.39%	EUR	100.39%	72	502 012
ENIIM 4.25% 02/20	700 000	108.75%	EUR	108.75%	27 060	788 331
ENELIM 4.875% 02/18	2 900 000	100.65%	EUR	100.65%	122 009	3 040 714
ISPIM 1.125% 01/2020	1 600 000	102.08%	EUR	102.08%	17 359	1 650 575
ISPIM 4.125% 04/2020	750 000	109.04%	EUR	109.04%	22 207	839 970
UCGIM 5% 05/2018	475 000	101.92%	EUR	101.92%	14 640	498 782
UCGIM 5.65% 08/2018	1 000 000	103.60%	EUR	103.60%	20 123	1 056 143
UCGIM 6.1% 03/2018	600 000	101.20%	EUR	101.20%	29 180	636 380
ISPIM Float 04/22	450 000	102.45%	EUR	102.45%	574	461 586
GS 5.125% 10/2019	1 200 000	109.31%	EUR	109.31%	11 795	1 323 539
MS 2.25% 03/2018	2 000 000	100.40%	EUR	100.40%	36 370	2 044 310
BAC 2.5% 07/2020	750 000	106.19%	EUR	106.19%	8 116	804 541
JPM Float 06/2018	650 000	100.15%	EUR	100.15%		650 975
MS Float 01/22	500 000	101.12%	EUR	101.12%	338	505 933
MS Float 03/12/2019	200 000	100.38%	EUR	100.38%	27	200 789
BAC Float 02/22	200 000	101.52%	EUR	101.52%	144	203 188
BAC Float 05/23	400 000	101.79%	EUR	101.79%	281	407 437
GM Float 05/21	1 800 000	100.82%	EUR	100.82%	913	1 815 655
T Float 09/2023	1 500 000	101.60%	EUR	101.60%	611	1 524 611

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2017-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
TMO Float 07/2019	1 500 000	100.27%	EUR	100.27%		1 504 020
BATSLN Float 08/21	500 000	100.65%	EUR	100.65%	109	503 344
BAC Float 09/21	500 000	100.20%	EUR	100.20%	6	501 021
GS Float 09/23	1 100 000	100.49%	EUR	100.49%	44	1 105 478
UTX Float 11/19	1 500 000	100.41%	EUR	100.41%		1 506 135
CS 1.375% 11/2019	1 200 000	102.78%	EUR	102.78%	1 492	1 234 888
UBS Float 09/2019	400 000	100.78%	EUR	100.78%	52	403 168
REPSM 4.875% 02/2019	2 500 000	105.46%	EUR	105.46%	105 514	2 741 939
IBESM 4.25% 10/2018	1 200 000	103.38%	EUR	103.38%	11 458	1 252 042
ENELIM 4.875% 03/20	1 250 000	110.61%	EUR	110.61%	49 418	1 432 043
REPSM 4.375% 02/2018	1 700 000	100.58%	EUR	100.58%	64 187	1 773 979
ACHMEA 2% 01/2018	1 300 000	100.13%	EUR	100.13%	24 433	1 326 058
REPSM 2.625% 05/2020	2 500 000	106.01%	EUR	106.01%	39 195	2 689 545
IBESM 2.875% 11/2020	1 000 000	107.95%	EUR	107.95%	4 017	1 083 497
ACHMEA 2.5% 11/2020	2 800 000	106.53%	EUR	106.53%	8 247	2 991 087
NOMURA 1.125% 06/20	1 000 000	102.19%	EUR	102.19%	6 534	1 028 404
ACHMEA 0.875% 09/18	4 000 000	100.76%	EUR	100.76%	10 164	4 040 444
ABNANV Float 01/19	600 000	100.46%	EUR	100.46%	219	603 003
MYL FLOAT 11/18	1 200 000	100.48%	EUR	100.48%	721	1 206 469
VW 0.5% 03/21	600 000	100.71%	EUR	100.71%	2 277	606 537
VW Float 03/19	600 000	100.17%	EUR	100.17%	1	601 015
BMW 0.125% 07/20	3 000 000	100.32%	EUR	100.32%	1 870	3 011 470
LPTY Float 11/20	800 000	100.59%	EUR	100.59%	238	804 942
MYL Float 05/20	800 000	100.17%	EUR	100.17%	144	801 512
PHIANA Float 09/2019	750 000	100.41%	EUR	100.41%		753 060
AKZANA Float 11/19	900 000	100.38%	EUR	100.38%		903 429
ANNGR FLOAT 11/19	500 000	100.40%	EUR	100.40%	12	502 007
ALVGR Float 12/20	300 000	101.39%	EUR	101.39%	38	304 208
SYDBDC Float 05/18	500 000	100.16%	EUR	100.16%	123	500 903
NYKRE Float 06/22	1 000 000	100.61%	EUR	100.61%	187	1 006 237
JYBC Float 06/20	1 000 000	100.44%	EUR	100.44%	16	1 004 376
KBCBB Float 11/22	500 000	101.15%	EUR	101.15%	117	505 842
GE 2.875% 06/2019	1 000 000	104.39%	EUR	104.39%	15 517	1 059 457
GE 2.25% 07/2020	2 000 000	105.57%	EUR	105.57%	20 342	2 131 662
DLTAS 2008-1 A	1 091 073	99.43%	EUR	99.43%	55	1 084 887
DHR Float 06/22	700 000	100.39%	EUR	100.39%		702 700
DE Float 09/20	1 000 000	100.46%	EUR	100.46%		1 004 610
SUMIBK Float 06/22	500 000	100.59%	EUR	100.59%	31	503 001
BMO Float 09/21	750 000	101.25%	EUR	101.25%	14	759 382
BNS FLOAT 10/22	1 000 000	101.68%	EUR	101.68%	660	1 017 470
ICBCAS FLOAT 10/20	1 000 000	100.24%	EUR	100.24%	497	1 002 867
BCHINA Float 11/20	300 000	100.14%	EUR	100.14%	47	300 473
AMXLMM 4.125%10/2019	700 000	107.32%	EUR	107.32%	5 379	756 612
AMXLMM 1% 06/2018	2 500 000	100.40%	EUR	100.40%	14 452	2 524 477
CAFP FLT 03/18	700 000	100.14%	EUR	100.14%	94	701 060
GLENLN 2.625% 11/18	800 000	102.23%	EUR	102.23%	2 474	820 314
BACR Float 03/2021	900 000	96.34%	EUR	96.34%	35	867 127

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2017-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
CCBGBB Float 03/18	500 000	100.04%	EUR	100.04%	26	500 206
GSFloat 10/2019	50 000	101.10%	EUR	101.10%	37	50 584
GS Float 09/2018	500 000	100.39%	EUR	100.39%	95	502 050
BAC Float 05/2019	700 000	101.43%	EUR	101.43%	1 232	711 235
C Float 11/2019	100 000	100.82%	EUR	100.82%	30	100 847
ANNGR Float 09/18	500 000	100.12%	EUR	100.12%	14	500 619
UNANA Float 06/18	500 000	100.12%	EUR	100.12%		500 620
SOCGEN Float 02/18	200 000	100.05%	EUR	100.05%	5	200 105
BSN Float 09/2018	500 000	100.26%	EUR	100.26%	16	501 331
BATSLN Float 03/2018	500 000	100.06%	EUR	100.06%	63	500 368
RY Float 03/2019	300 000	100.53%	EUR	100.53%	5	301 586
RY Float 10/2018	500 000	100.35%	EUR	100.35%	98	501 853
DAIGR Float 01/2019	200 000	100.36%	EUR	100.36%	90	200 816
DAIGR Float 03/18	100 000	100.07%	EUR	100.07%	9	100 075
VOD Float 02/2019	200 000	100.92%	EUR	100.92%	121	201 961
RENAUL Float 03/19	600 000	101.02%	EUR	101.02%	156	606 282
NAB Float 01/18	500 000	100.02%	EUR	100.02%		500 075
NDASS Float 02/19	200 000	100.49%	EUR	100.49%	27	201 013
ENELIM Float 02/2018	500 000	100.41%	EUR	100.41%	5 226	507 256
CAT Float 05/2018	200 000	100.07%	EUR	100.07%		200 130
UCGIM Float 02/2020	650 000	101.61%	EUR	101.61%	509	660 948
MAERSK Float 03/19	200 000	101.69%	EUR	101.69%	99	203 473
HON Float 02/18	100 000	100.06%	EUR	100.06%	19	100 079
COVEGR Float 03/18	200 000	100.08%	EUR	100.08%	32	200 192
FDX Float 04/19	300 000	100.49%	EUR	100.49%	151	301 624
CAPFP Float 07/2018	700 000	100.18%	EUR	100.18%	922	702 182
VW Float 07/2018	100 000	100.08%	EUR	100.08%		100 082
F Float 02/2018	500 000	100.02%	EUR	100.02%	102	500 222
BPCEGP Float 05/2018	500 000	100.27%	EUR	100.27%	156	501 506
ISPIM Float 04/2019	600 000	101.15%	EUR	101.15%	913	607 795
ISPIM Float 06/20	200 000	101.98%	EUR	101.98%	68	204 018
INTNED Float 02/18	200 000	100.07%	EUR	100.07%	40	200 171
NWIDE Float 11/2018	700 000	100.41%	EUR	100.41%	197	703 095
BMW Float 04/2018	700 000	100.07%	EUR	100.07%		700 462
SWEDA FLOAT 03/19	200 000	100.88%	EUR	100.88%	50	201 804
						164 480 197
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					19 894	7 114 672
Obrigações diversas						
HUWY 1.375% 10/2021	2 000 000	103.48%	EUR	103.48%	4 671	2 074 191
K 1.75% 05/2021	1 000 000	104.83%	EUR	104.83%	10 644	1 058 934
KO Float 03/19	300 000	100.36%	EUR	100.36%		301 074
UBS Float 09/22	1 000 000	101.46%	EUR	101.46%	124	1 014 694
AGN Float 06/19	1 000 000	100.14%	EUR	100.14%	18	1 001 408
WESAU 1.25% 10/2021	1 500 000	103.95%	EUR	103.95%	4 418	1 563 698
AT&T Float 06/19	100 000	100.65%	EUR	100.65%	20	100 674
						7 114 672

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2017-12-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
						187 720 358
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC domiciliados em Portugal						36 951 893
CXG OBRIGAÇÕES	2 258 307	4.49	EUR	4.49		10 129 182
CXG LIQUIDEZ	5 021 569	5.34	EUR	5.34		26 822 711
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						24 927 067
AXA WF EUR SD-I-XC€	248 649	100.25	EUR	100.25		24 927 067
						61 878 960
LIQUIDEZ						
À vista						5 915 691
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.0000%	EUR					5 915 691
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
Valores Passivos						-196 549
						-196 549
						255 318 460
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					43 232 878.85	

Valor da Unidade de Participação: € 5.9057