

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
 Composição da Carteira em 2017-10-31

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.					148 573	11 140 439
Títulos de Dívida Pública						
OT 4.8% 06/2020	1 250 000	112.34%	EUR	112.34%	22 849	1 427 074
OT 3.85% 04/2021	1 750 000	112.37%	EUR	112.37%	36 918	2 003 410
OT 4.75% 06/2019	2 000 000	107.90%	EUR	107.90%	36 438	2 194 378
						5 624 863
Obrigações diversas						
CXGD 3% 01/2019	600 000	103.70%	EUR	103.70%	14 301	636 477
VERSE 2 SNR 02/2018	430 315	100.44%	EUR	100.44%	534	432 745
TAGST 09-ENGY A1/25	802 154	101.80%	EUR	101.80%	704	817 296
CXGD 1% 01/2022	700 000	101.95%	EUR	101.95%	5 332	718 996
VERSE 3 SNR 02/2019	1 426 014	101.25%	EUR	101.25%	1 498	1 445 337
VERSE 4 SNR 02/2021	413 997	103.00%	EUR	103.00%	512	426 929
CXGD 3.75% 01/2018	1 000 000	100.83%	EUR	100.83%	29 486	1 037 796
						5 515 576
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					1 902 163	169 598 966
Títulos de Dívida Pública						
FADE 0.031% 06/2020	5 400 000	100.15%	EUR	100.15%	633	5 408 625
Obrigações diversas						
RENEPL 4.125% 01/18	500 000	101.00%	EUR	101.00%	15 483	520 483
DAIGR Float 07/24	1 000 000	100.44%	EUR	100.44%	97	1 004 517
VW Float 07/19	1 100 000	100.11%	EUR	100.11%	17	1 101 183
COFP 4.481% 11/2018	6 000 000	105.80%	EUR	105.80%	260 757	6 608 997
LGFP 5.375% 11/2018	5 000 000	105.78%	EUR	105.78%	248 134	5 536 934
MWDP 6.75% 04/2018	4 000 000	103.13%	EUR	103.13%	144 247	4 269 487
COFP 3.994 03/2020	1 000 000	111.65%	EUR	111.65%	25 934	1 142 394
PPFP 3.125% 04/2019	1 200 000	104.90%	EUR	104.90%	19 726	1 278 526
RENAUL 1.125% 09/19	1 200 000	102.31%	EUR	102.31%	1 184	1 228 928
MCFP 1% 09/2021	1 400 000	103.70%	EUR	103.70%	1 458	1 453 188
BPCEGP 5.1% 06/2018	1 480 000	103.44%	EUR	103.44%	7 258	1 538 221
RENAUL 3.625% 09/18	2 000 000	103.31%	EUR	103.31%	8 541	2 074 821
KERFP 1.875% 10/2018	1 500 000	101.94%	EUR	101.94%	1 849	1 530 979
BPCEGP 3.7% 05/2018	2 530 000	101.99%	EUR	101.99%	20 096	2 600 392
BNFP Float 11/18	400 000	100.24%	EUR	100.24%		400 964
RENAULT Float 08/20	100 000	100.46%	EUR	100.46%	8	100 470
BPCEGP Float 03/22	500 000	103.09%	EUR	103.09%	510	515 940
RENAULT Float 04/21	100 000	100.97%	EUR	100.97%	18	100 990
ACAFP Float 04/22	1 000 000	102.17%	EUR	102.17%	157	1 021 817
MCFP 0% 05/20	4 300 000	100.37%	EUR	100.37%		4 315 867
MCFP Float 11/18	465 000	100.30%	EUR	100.30%		466 390
BNP Float 06/24	800 000	101.81%	EUR	101.81%	515	814 955
RENAUL Float 03/2022	400 000	101.33%	EUR	101.33%	181	405 497
GFCFP Float 06/22	800 000	100.28%	EUR	100.28%	36	802 300

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2017-10-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ABBEY 2.625% 07/2020	750 000	107.00%	EUR	107.00%	5 825	808 310
LLOYDS 1.875% 10/18	1 500 000	102.03%	EUR	102.03%	1 695	1 532 070
ABBEY 2% 01/2019	1 000 000	102.64%	EUR	102.64%	15 945	1 042 295
DGELN 1.125% 05/2019	1 000 000	101.93%	EUR	101.93%	5 086	1 024 336
F 1.75% 05/18	5 000 000	101.00%	EUR	101.00%	39 315	5 089 065
ABBEY 0.875% 01/2020	500 000	101.98%	EUR	101.98%	3 500	513 410
LLOYDS 0.625% 04/20	1 500 000	101.74%	EUR	101.74%	5 009	1 531 079
HSBC Float 09/22	750 000	101.49%	EUR	101.49%	271	761 476
F Float 08/20	300 000	100.49%	EUR	100.49%	91	301 564
WPPLN Float 05/20	800 000	100.31%	EUR	100.31%		802 488
SANUK Float 05/23	500 000	101.36%	EUR	101.36%	470	507 255
RBS Float 06/20	900 000	100.54%	EUR	100.54%	136	904 996
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	101.81%	EUR	101.81%	513	1 018 643
HSBC 0.17% 10/23	500 000	100.58%	EUR	100.58%	64	502 959
TELEFO 4.693% 11/19	1 000 000	109.73%	EUR	109.73%	45 644	1 142 934
REDELE 4.875% 04/202	1 000 000	112.50%	EUR	112.50%	24 842	1 149 852
TELEFO 4.797 02/2018	5 000 000	101.50%	EUR	101.50%	166 252	5 241 452
CABKSM 3.125% 05/18	4 000 000	101.63%	EUR	101.63%	58 562	4 123 562
SANTAN 1.1% 07/2018	2 000 000	100.96%	EUR	100.96%	5 726	2 024 886
SANSCF Float 01/19	600 000	100.21%	EUR	100.21%	42	601 296
IBESM Float 02/24	1 100 000	101.01%	EUR	101.01%	750	1 111 910
SANTAN Float 03/22	600 000	101.79%	EUR	101.79%	472	611 200
BBVASM Float 04/22	1 200 000	101.12%	EUR	101.12%	181	1 213 633
CRUNAV Float 06/2022	500 000	100.28%	EUR	100.28%	182	501 590
VLVY 2.375% 11/26/19	250 000	105.07%	EUR	105.07%	5 531	268 208
SCANIA Float 10/18	500 000	100.23%	EUR	100.23%	2	501 142
SCANIA Float 04/20	500 000	100.39%	EUR	100.39%	12	501 972
ENIIM 4.25% 02/20	700 000	109.81%	EUR	109.81%	22 088	790 772
ISPIM 4% 11/2017	2 000 000	100.06%	EUR	100.06%	78 247	2 079 447
ENELIM 4.875% 02/18	2 900 000	101.53%	EUR	101.53%	98 382	3 042 723
ISPIM 1.125% 01/2020	1 600 000	102.38%	EUR	102.38%	14 351	1 652 463
ISPIM 4.125% 04/2020	750 000	109.92%	EUR	109.92%	17 037	841 399
UCGIM 5% 05/2018	475 000	102.75%	EUR	102.75%	10 671	498 734
UCGIM 5.65% 08/2018	1 000 000	104.61%	EUR	104.61%	10 681	1 056 741
UCGIM 6.1% 03/2018	600 000	102.27%	EUR	102.27%	23 063	636 683
UCGIM 1.8% 12/2017	1 700 000	100.44%	EUR	100.44%	27 379	1 734 859
ISPIM Float 04/22	450 000	102.24%	EUR	102.24%	101	460 163
GS 5.125% 10/2019	1 200 000	110.28%	EUR	110.28%	1 516	1 324 900
MS 2.25% 03/2018	2 000 000	100.90%	EUR	100.90%	28 849	2 046 869
BAC 2.5% 07/2020	750 000	106.85%	EUR	106.85%	4 983	806 388
JPM Float 06/2018	650 000	100.20%	EUR	100.20%		651 268
MS Float 01/22	500 000	101.09%	EUR	101.09%	26	505 451
MS Float 03/12/2019	200 000	100.34%	EUR	100.34%	54	200 726
BAC Float 02/22	200 000	101.41%	EUR	101.41%	225	203 043
GS Float 09/22	500 000	100.64%	EUR	100.64%	213	503 403
BAC Float 05/23	400 000	101.36%	EUR	101.36%	444	405 884
MS Float 11/22	600 000	101.18%	EUR	101.18%	526	607 606

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2017-10-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
GM Float 05/21	1 200 000	100.99%	EUR	100.99%	974	1 212 866
T Float 09/2023	1 500 000	102.83%	EUR	102.83%	1 237	1 543 627
TMO Float 07/2019	1 500 000	100.30%	EUR	100.30%		1 504 440
BATSLN Float 08/21	500 000	100.69%	EUR	100.69%	183	503 633
BAC Float 09/21	500 000	100.06%	EUR	100.06%	23	500 318
CS 1.375% 11/2019	1 200 000	103.10%	EUR	103.10%	15 234	1 252 434
UBS Float 09/2019	400 000	100.83%	EUR	100.83%	108	403 424
REPSM 4.875% 02/2019	2 500 000	106.45%	EUR	106.45%	85 146	2 746 371
IBESM 4.25% 10/2018	1 200 000	104.20%	EUR	104.20%	2 934	1 253 274
ENELIM 4.875% 03/20	1 250 000	111.79%	EUR	111.79%	39 234	1 436 584
REPSM 4.375% 02/2018	1 700 000	101.34%	EUR	101.34%	51 757	1 774 537
ACHMEA 2% 01/2018	1 300 000	100.51%	EUR	100.51%	20 088	1 326 718
REPSM 2.625% 05/2020	2 500 000	106.76%	EUR	106.76%	28 228	2 697 203
IBESM 2.875% 11/2020	1 000 000	108.91%	EUR	108.91%	27 962	1 117 012
ACHMEA 2.5% 11/2020	2 800 000	107.23%	EUR	107.23%	66 548	3 068 932
NOMURA 1.125% 06/20	1 000 000	102.67%	EUR	102.67%	4 654	1 031 394
ACHMEA 0.875% 09/18	4 000 000	100.94%	EUR	100.94%	4 315	4 041 915
ABNANV Float 01/19	600 000	100.52%	EUR	100.52%	46	603 184
MYL FLOAT 11/18	1 200 000	100.61%	EUR	100.61%	1 280	1 208 576
VW 0.5% 03/21	600 000	101.12%	EUR	101.12%	1 775	608 513
VW Float 03/19	600 000	100.18%	EUR	100.18%	12	601 068
BMW 0.125% 07/20	3 000 000	100.65%	EUR	100.65%	1 243	3 020 623
LPTY Float 11/20	800 000	100.55%	EUR	100.55%	374	804 766
MYL Float 05/20	800 000	100.42%	EUR	100.42%	264	803 624
PHIANA Float 09/2019	750 000	100.45%	EUR	100.45%		753 383
SYDBDC Float 05/18	500 000	100.18%	EUR	100.18%	218	501 123
NYKRE Float 06/22	1 000 000	100.40%	EUR	100.40%	388	1 004 368
JYBC Float 06/20	1 000 000	100.48%	EUR	100.48%	34	1 004 794
KBCBB Float 11/22	500 000	101.07%	EUR	101.07%	213	505 578
GE 2.875% 06/2019	1 000 000	105.07%	EUR	105.07%	10 712	1 061 372
GE 2.25% 07/2020	2 000 000	106.37%	EUR	106.37%	12 822	2 140 182
DLTAS 2008-1 A	1 123 532	99.41%	EUR	99.41%	50	1 116 953
DHR Float 06/22	700 000	100.40%	EUR	100.40%		702 772
DE Float 09/20	1 000 000	100.49%	EUR	100.49%		1 004 910
SUMIBK Float 06/22	500 000	100.64%	EUR	100.64%	80	503 255
BMO Float 09/21	750 000	101.26%	EUR	101.26%	121	759 556
BNS FLOAT 10/22	1 000 000	101.76%	EUR	101.76%	203	1 017 813
ICBCAS FLOAT 10/20	1 000 000	100.26%	EUR	100.26%	123	1 002 753
AMXLMM 4.125%10/2019	700 000	108.23%	EUR	108.23%	554	758 164
AMXLMM 1% 06/2018	2 500 000	100.60%	EUR	100.60%	10 274	2 525 249
CAFP FLT 03/18	700 000	100.23%	EUR	100.23%	349	701 987
GLENLN 2.625% 11/18	800 000	102.76%	EUR	102.76%	19 964	842 044
BACR Float 03/2021	900 000	95.51%	EUR	95.51%	141	859 758
CCBGBB Float 03/18	500 000	100.08%	EUR	100.08%	97	500 482
GSFloat 10/2019	50 000	101.09%	EUR	101.09%	1	50 546
GS Float 09/2018	500 000	100.47%	EUR	100.47%	227	502 577
BAC Float 05/2019	700 000	101.68%	EUR	101.68%	1 913	713 659

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2017-10-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
C Float 11/2019	100 000	100.84%	EUR	100.84%	51	100 886
ANNGR Float 09/18	500 000	100.15%	EUR	100.15%	33	500 793
UNANA Float 06/18	500 000	100.17%	EUR	100.17%		500 840
SOCGEN Float 02/18	200 000	100.11%	EUR	100.11%	8	200 228
BSN Float 09/2018	500 000	100.32%	EUR	100.32%	35	501 635
BATSLN Float 03/2018	500 000	100.14%	EUR	100.14%	133	500 808
RY Float 03/2019	300 000	100.59%	EUR	100.59%	35	301 817
RY Float 10/2018	500 000	100.42%	EUR	100.42%	13	502 118
DAIGR Float 01/2019	200 000	100.42%	EUR	100.42%	22	200 862
DAIGR Float 03/18	100 000	100.12%	EUR	100.12%	21	100 136
VOD Float 02/2019	200 000	101.15%	EUR	101.15%	235	202 535
RENAUL Float 03/19	600 000	101.14%	EUR	101.14%	492	607 332
NAB Float 01/18	500 000	100.07%	EUR	100.07%		500 355
NDASS Float 02/19	200 000	100.56%	EUR	100.56%	48	201 166
ENELIM Float 02/2018	500 000	100.92%	EUR	100.92%	2 829	507 429
CAT Float 05/2018	200 000	100.09%	EUR	100.09%		200 182
UCGIM Float 12/2017	650 000	100.23%	EUR	100.23%	1 267	652 736
UCGIM Float 02/2020	650 000	101.72%	EUR	101.72%	872	662 078
MAERSK Float 03/19	200 000	101.91%	EUR	101.91%	311	204 137
HON Float 02/18	100 000	100.13%	EUR	100.13%	34	100 168
COVEGR Float 03/18	200 000	100.14%	EUR	100.14%	77	200 351
ALDINT Float 11/2017	200 000	100.03%	EUR	100.03%	95	200 160
FDX Float 04/19	300 000	100.53%	EUR	100.53%	39	301 632
CAPFP Float 07/2018	700 000	100.31%	EUR	100.31%	304	702 481
VW Float 07/2018	100 000	100.10%	EUR	100.10%		100 100
F Float 02/2018	500 000	100.08%	EUR	100.08%	164	500 539
BPCEGP Float 05/2018	500 000	100.37%	EUR	100.37%	299	502 134
ISPIM Float 04/2019	600 000	101.28%	EUR	101.28%	180	607 842
ISPIM Float 06/20	200 000	102.04%	EUR	102.04%	188	204 274
INTNED Float 02/18	200 000	100.15%	EUR	100.15%	68	200 374
NWIDE Float 11/2018	700 000	100.49%	EUR	100.49%	301	703 696
BMW Float 04/2018	700 000	100.11%	EUR	100.11%		700 770
SWEDA FLOAT 03/19	200 000	100.99%	EUR	100.99%	119	202 093
						164 190 341
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					9 585	7 139 988
Obrigações diversas						
HUWY 1.375% 10/2021	2 000 000	104.24%	EUR	104.24%	75	2 084 815
K 1.75% 05/2021	1 000 000	105.57%	EUR	105.57%	7 719	1 063 369
KO Float 03/19	300 000	100.43%	EUR	100.43%		301 281
UBS Float 09/22	1 000 000	101.43%	EUR	101.43%	433	1 014 713
AGN Float 06/19	1 000 000	100.15%	EUR	100.15%	34	1 001 564
WESAU 1.25% 10/2021	1 500 000	104.81%	EUR	104.81%	1 284	1 573 449
AT&T Float 06/19	100 000	100.76%	EUR	100.76%	40	100 797
						7 139 988
						187 879 393

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2017-10-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC domiciliados em Portugal						36 955 100
CXG OBRIGAÇÕES	2 258 307	4.49	EUR	4.49		10 140 925
CXG LIQUIDEZ	5 021 569	5.34	EUR	5.34		26 814 174
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						32 017 511
AXA WF EU CREDIT	182 555	136.84	EUR	136.84		24 980 826
Natixis Tresorie I	561	12 543.11	EUR	12 543.11		7 036 685
						68 972 610
LIQUIDEZ						
À vista						4 168 589
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			4 168 589
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
Valores Passivos						-69 941
						-69 941
						260 950 651
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					44 142 690.32	

Valor da Unidade de Participação: € 5.9115