

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
 Composição da Carteira em 2018-07-31

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.					5 264	2 413 338
Obrigações diversas						
TAGST 09-ENGY A1/25	724 383	101.00%	EUR	101.00%	636	732 263
CXGD 1% 01/2022	700 000	102.14%	EUR	102.14%	3 567	718 561
VERSE 3 SNR 02/2019	628 536	100.25%	EUR	100.25%	660	630 767
VERSE 4 SNR 02/2021	323 738	102.35%	EUR	102.35%	401	331 747
						2 413 338
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					703 189	102 343 934
Titulos de Dívida Pública						
FADE 0.031% 06/2020	5 400 000	100.34%	EUR	100.34%	206	5 418 350
Obrigações diversas						
NOSPL 1.125% 05/23	2 500 000	100.37%	EUR	100.37%	7 012	2 516 362
DAIGR Float 07/24	1 000 000	99.13%	EUR	99.13%	104	991 394
BASGR Float 11/19	1 300 000	100.30%	EUR	100.30%		1 303 913
SAPGR Float 03/21	1 100 000	100.44%	EUR	100.44%		1 104 873
COFP 4.481% 11/2018	6 000 000	101.37%	EUR	101.37%	246 826	6 328 726
COFP 5.244% 03/2020	1 000 000	104.94%	EUR	104.94%	20 832	1 070 242
RENAUL 1.125% 09/19	1 200 000	101.27%	EUR	101.27%	11 281	1 226 521
MCFP 1% 09/2021	1 400 000	102.80%	EUR	102.80%	11 929	1 451 143
RENAULT Float 08/20	100 000	100.19%	EUR	100.19%	8	100 193
BPCEGP Float 03/22	500 000	101.48%	EUR	101.48%	516	507 931
RENAULT Float 04/21	100 000	100.38%	EUR	100.38%	18	100 396
ACAFP Float 04/22	1 000 000	100.66%	EUR	100.66%	160	1 006 740
MCFP 0% 05/20	4 300 000	100.08%	EUR	100.08%		4 303 569
BNP Float 06/24	800 000	100.38%	EUR	100.38%	523	803 563
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.03%	EUR	100.03%	186	400 314
GFCFP Float 06/22	800 000	99.76%	EUR	99.76%	41	798 145
ALDFP Float 11/20	500 000	100.00%	EUR	100.00%	96	500 106
SANFP Float 03/20	900 000	100.37%	EUR	100.37%		903 330
BNP Float 05/23	500 000	99.81%	EUR	99.81%	290	499 360
ABBEY 2.625% 07/2020	750 000	104.94%	EUR	104.94%	863	787 898
ABBEY 0.875% 01/2020	500 000	101.25%	EUR	101.25%	2 397	508 657
LLOYDS 0.625% 04/20	1 500 000	101.12%	EUR	101.12%	2 646	1 519 461
HSBC Float 09/22	750 000	100.63%	EUR	100.63%	274	755 022
F Float 08/20	300 000	100.23%	EUR	100.23%	94	300 793
WPPLN Float 05/20	800 000	100.08%	EUR	100.08%		800 608
SANUK Float 05/23	500 000	99.79%	EUR	99.79%	473	499 443
RBS Float 06/20	900 000	100.06%	EUR	100.06%	147	900 660
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	100.02%	EUR	100.02%	520	1 000 690
HSBC 0.17% 10/23	500 000	99.81%	EUR	99.81%	67	499 107
RBS Float 03/2020	100 000	100.01%	EUR	100.01%	13	100 019
GSK Float 05/20	500 000	100.33%	EUR	100.33%		501 625
TELEFO 4.693% 11/19	1 000 000	105.94%	EUR	105.94%	33 815	1 093 245

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
REDELE 4.875% 04/202	1 000 000	108.44%	EUR	108.44%	12 555	1 096 915
IBESM Float 02/24	1 100 000	100.88%	EUR	100.88%	757	1 110 448
SANTAN Float 03/22	600 000	101.10%	EUR	101.10%	476	607 082
CRUNAV Float 06/2022	500 000	99.82%	EUR	99.82%	186	499 296
VLVY 2.375% 11/26/19	250 000	103.11%	EUR	103.11%	4 034	261 817
SCANIA Float 04/20	500 000	100.18%	EUR	100.18%	13	500 918
ENIIM 4.25% 02/20	700 000	106.25%	EUR	106.25%	14 590	758 354
ISPIM 1.125% 01/2020	1 600 000	100.63%	EUR	100.63%	9 814	1 619 942
ISPIM 4.125% 04/2020	750 000	105.75%	EUR	105.75%	9 239	802 379
UCGIM 5.65% 08/2018	1 000 000	100.33%	EUR	100.33%	52 940	1 056 240
ISPIM 2% 06/2021	1 000 000	102.76%	EUR	102.76%	2 411	1 030 031
ISPIM Float 04/22	450 000	98.28%	EUR	98.28%	102	442 353
GS 5.125% 10/2019	1 200 000	106.28%	EUR	106.28%	47 515	1 322 887
BAC 2.5% 07/2020	750 000	104.92%	EUR	104.92%	257	787 142
MS Float 01/22	500 000	100.42%	EUR	100.42%	26	502 121
MS Float 03/12/2019	200 000	100.11%	EUR	100.11%	58	200 278
BAC Float 02/22	200 000	100.77%	EUR	100.77%	226	201 772
BAC Float 05/23	400 000	100.57%	EUR	100.57%	446	402 734
GM Float 05/21	1 800 000	100.50%	EUR	100.50%	1 461	1 810 479
BATSLN Float 08/21	500 000	99.94%	EUR	99.94%	186	499 886
BAC Float 09/21	500 000	99.94%	EUR	99.94%	27	499 722
GS Float 09/23	1 100 000	99.04%	EUR	99.04%	327	1 089 789
UTX Float 11/19	1 500 000	100.16%	EUR	100.16%		1 502 445
T Float 09/2023	1 500 000	100.97%	EUR	100.97%	1 278	1 515 888
MS Float 05/21	500 000	99.94%	EUR	99.94%	74	499 769
CS 1.375% 11/2019	1 200 000	102.00%	EUR	102.00%	11 075	1 235 015
UBS Float 04/2021	200 000	100.55%	EUR	100.55%	9	201 101
ENELIM 4.875% 03/20	1 250 000	107.76%	EUR	107.76%	23 874	1 370 874
REPSM 2.625% 05/2020	2 500 000	104.62%	EUR	104.62%	11 687	2 627 237
IBESM 2.875% 11/2020	1 000 000	106.40%	EUR	106.40%	20 716	1 084 726
RENEPL 4.75% 10/2020	1 000 000	109.83%	EUR	109.83%	37 610	1 135 910
ACHMEA 2.5% 11/2020	2 800 000	105.28%	EUR	105.28%	48 904	2 996 744
NOMURA 1.125% 06/20	1 000 000	101.96%	EUR	101.96%	1 818	1 021 378
MYL FLOAT 11/18	1 200 000	100.19%	EUR	100.19%	1 287	1 203 591
BMW 0.125% 07/20	3 000 000	100.31%	EUR	100.31%	298	3 009 508
LPTY Float 11/20	800 000	100.35%	EUR	100.35%	378	803 210
MYL Float 05/20	800 000	100.15%	EUR	100.15%	270	801 446
AKZANA Float 11/19	900 000	100.18%	EUR	100.18%		901 620
ANNGR FLOAT 11/19	500 000	100.18%	EUR	100.18%	24	500 919
ALVGR Float 12/20	300 000	100.96%	EUR	100.96%	82	302 947
LPTY Float 01/21	200 000	100.34%	EUR	100.34%	7	200 693
ADNA Float 03/21	200 000	100.08%	EUR	100.08%		200 152
DAIGR Float 04/20	300 000	100.45%	EUR	100.45%	34	301 393
TOYOTA FLT 04/27	500 000	100.25%	EUR	100.25%	2	501 252
BAYNGR 0.625% 12/22	100 000	100.85%	EUR	100.85%	62	100 916
BAYNGR Float 06/22	300 000	100.60%	EUR	100.60%	68	301 862
ABNANV 0.5% 07/2023	2 000 000	99.41%	EUR	99.41%	411	1 988 691

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
NIBCAP Float 07/20	900 000	100.13%	EUR	100.13%	9	901 197
NYKRE Float 06/22	1 000 000	99.94%	EUR	99.94%	401	999 811
JYBC Float 06/20	1 000 000	100.31%	EUR	100.31%	47	1 003 097
MINGNO 0.75% 03/23	2 000 000	99.68%	EUR	99.68%	1 192	1 994 812
CBSBKF Float 03/21	600 000	100.30%	EUR	100.30%	161	601 931
KBCBB Float 11/22	500 000	99.85%	EUR	99.85%	217	499 447
GE 2.25% 07/2020	2 000 000	104.27%	EUR	104.27%	1 479	2 086 919
DLTAS 2008-1 A	977 106	99.49%	EUR	99.49%	44	972 138
DHR Float 06/22	700 000	99.93%	EUR	99.93%		699 524
DE Float 09/20	1 000 000	100.20%	EUR	100.20%		1 001 950
SUMIBK Float 06/22	500 000	99.76%	EUR	99.76%	86	498 891
BNS FLOAT 10/22	1 000 000	101.00%	EUR	101.00%	209	1 010 179
BCHINA Float 11/20	300 000	99.90%	EUR	99.90%	85	299 779
AMXLMM 4.125%10/2019	700 000	105.02%	EUR	105.02%	22 151	757 291
GLENLN 2.625% 11/18	800 000	100.66%	EUR	100.66%	14 671	819 935
BACR Float 03/2021	900 000	96.40%	EUR	96.40%	147	867 738
GSFloat 10/2019	50 000	100.63%	EUR	100.63%	1	50 314
BAC Float 05/2019	700 000	100.71%	EUR	100.71%	1 915	706 885
C Float 11/2019	100 000	100.51%	EUR	100.51%	51	100 561
RY Float 03/2019	300 000	100.26%	EUR	100.26%	37	300 814
RY Float 10/2018	500 000	100.09%	EUR	100.09%	14	500 469
UCGIM Float 02/2020	650 000	100.29%	EUR	100.29%	876	652 748
ISPIM Float 04/2019	600 000	100.18%	EUR	100.18%	182	601 280
ISPIM Float 06/20	200 000	100.09%	EUR	100.09%	190	200 368
SWEDA FLOAT 08/2020	200 000	100.76%	EUR	100.76%	73	201 587
						96 925 584
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					39 767	5 996 028
Obrigações diversas						
HUWY 1.375% 10/2021	2 000 000	102.88%	EUR	102.88%	20 644	2 078 324
K 1.75% 05/2021	1 000 000	104.15%	EUR	104.15%	3 308	1 044 808
F Float 05/21	300 000	99.75%	EUR	99.75%	67	299 323
UBS Float 09/22	1 000 000	100.48%	EUR	100.48%	440	1 005 270
WESAU 1.25% 10/2021	1 500 000	103.53%	EUR	103.53%	15 308	1 568 303
						5 996 028
						110 753 300

OUTROS VALORES

Outros Intrumentos de Dívida					331	11 100 298
Papel Comercial						
PC P.COM.UNILEVER 52ªEM 0.0900% 2018-07-16 a 2018-08-16			EUR		30	750 030
PC PC C. AMORIM 8ª 27/7 0.0800% 2018-07-27 a 2018-08-31			EUR		33	3 000 033
PC PAP.COM. JMR 98ª EM. 0.0500% 2018-07-05 a 2018-08-03			EUR		30	799 998
PC PC C. AMORIM 8ª 31/7 0.0800% 2018-07-31 a 2018-08-31			EUR		2	700 002
PC PC SONAE 880ª 30/07 0.0500% 2018-07-30 a 2018-08-17			EUR		3	1 000 003
PC P.COM.UNILEVER 52ªEM 0.1300% 2018-07-16 a 2018-08-16			EUR		101	1 750 101
PC PC JMS 35ª 30/07 0.8500% 2018-07-30 a 2018-09-14			EUR		87	1 850 087

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
PC P.COM.UNILEVER 53*EM 0.0800% 2018-07-16 a 2018-08-16			EUR		44	1 250 044
						11 100 298
						11 100 298

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						36 826 096
CXG OBRIGAÇÕES	2 258 307	4.45	EUR	4.45		10 059 626
CXG LIQUIDEZ	5 021 569	5.33	EUR	5.33		26 766 469
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						24 817 661
AXA WF EUR SD-I-XC€	248 649	99.81	EUR	99.81		24 817 661
						61 643 757

LIQUIDEZ

À vista						7 533 443
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			7 523 443
DO SANTANDER - 0.0000%			EUR			5 000
DO BCP - EUR 0.0000%			EUR			5 000
						7 533 443
A prazo					9 620	42 009 620
Depósitos com pré aviso e a prazo						
DP DP BCP 05JUN 365D 0.1200% 2018-06-05 a 2019-06-05			EUR		2 850	15 002 850
DP DP BCP 12JUL 365D 0.1800% 2018-07-12 a 2019-07-12			EUR		500	5 000 500
DP DP SANTANDER 05JUN 0.1800% 2018-06-05 a 2019-06-05			EUR		6 270	22 006 270
						42 009 620
						49 543 063

EMPRÉSTIMOS

Descobertos						-1 741
DO EUR-RBS (GR+ 0.0000%)			EUR			-1 741

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						2 040
Valores Passivos						-62 365
						-60 325
						232 978 352

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO

RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS

OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO

Em mercado regulamentado

Futuros

OEU8 EUR EUX 09/18	-34	131.62	EUR	131.62		-4 475 080
--------------------	-----	--------	-----	--------	--	------------

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

39 586 448.98

Valor da Unidade de Participação: € 5.8853