

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2013-06-30

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.					157 761	5 603 337
Títulos de Dívida Pública						
OT 3.6% OUT/2014	40 000	99.85%	EUR	99.85%	1 022	40 960
OT 5.45% Set. 2013	2 650 000	100.29%	EUR	100.29%	111 187	2 768 748
						2 809 708
Obrigações diversas						
SANTAN 3.25% 10/2014	350 000	98.38%	EUR	98.38%	7 885	352 228
BPIPL 3.25% 01/2015	1 400 000	100.39%	EUR	100.39%	20 818	1 426 333
CXGD 3.75% 01/2018	1 000 000	99.82%	EUR	99.82%	16 849	1 015 068
						2 793 629
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					274 006	15 147 783
Títulos de Dívida Pública						
BTNS 2.5% 01/2014	46 000	100.69%	EUR	100.69%	536	46 855
SGLT 0 07/2013	366 000	96.14%	EUR	96.14%	13 257	365 133
SPGB 3.75% 10/2015	250 000	101.81%	EUR	101.81%	6 241	260 769
BTPS 3.75% 12/2013	82 000	100.62%	EUR	100.62%	134	82 639
CCTS Float 12/15	600 000	97.78%	EUR	97.78%	299	586 979
BGB Float 02/2016	350 000	101.08%	EUR	101.08%	367	354 164
						1 696 539
Obrigações diversas						
ACACB 3.5% 07/2014	2 000 000	100.75%	EUR	100.75%	66 164	2 081 237
CAIX.GALI 3% 11/2014	1 000 000	99.50%	EUR	99.50%	19 726	1 014 683
CAJAMM 4.375%11/15	500 000	100.27%	EUR	100.27%	12 821	514 164
SANTAN 3.5% 03/2015	250 000	101.48%	EUR	101.48%	2 709	256 401
BBVASM 4.375% 9/2015	1 000 000	99.91%	EUR	99.91%	33 921	1 033 009
BANEST 3.5% 01/2015	700 000	100.87%	EUR	100.87%	10 404	716 480
SANTAN 2.875% 01/18	500 000	99.30%	EUR	99.30%	5 986	502 470
BPIM 3.875% 03/2014	2 500 000	99.97%	EUR	99.97%	24 418	2 523 726
ISPIM 4.125% 01/2016	300 000	102.73%	EUR	102.73%	5 696	313 889
ISPIM 4.125% 09/2016	500 000	99.67%	EUR	99.67%	16 104	514 470
MER.LYNCH 4.625% /13	705 000	100.35%	EUR	100.35%	24 298	731 775
GE CAP 4.625% 07/14	500 000	101.40%	EUR	101.40%	22 935	529 913
CXGD 5.125% 02/2014	300 000	100.95%	EUR	100.95%	5 560	308 419
Telecom Italia 07/13	50 000	99.99%	EUR	99.99%	85	50 080
BNP Float 12/2014	100 000	100.21%	EUR	100.21%	45	100 255
BAC Float 02/2014	50 000	99.87%	EUR	99.87%	27	49 963
WSTP Float 10/2013	50 000	100.15%	EUR	100.15%	57	50 131
AAB Float 06/2015	7 000	95.40%	EUR	95.40%	4	6 682
ABNANV Float 10/2013	100 000	100.32%	EUR	100.32%	341	100 658
SOCGEN Float 01/2015	100 000	100.15%	EUR	100.15%	141	100 289
GE Float 04/2014	50 000	100.01%	EUR	100.01%	43	50 047
BAVB Float 10/14	35 000	98.65%	EUR	98.65%	36	34 562
UCGIM Float 02/2014	35 000	99.66%	EUR	99.66%	19	34 902

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
 Composição da Carteira em 2013-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
UCGIM Float 01/2016	200 000	99.38%	EUR	99.38%	378	199 128
RABOBK Float 01/2014	200 000	100.34%	EUR	100.34%	390	201 076
VW Float 17/02/2014	1 000 000	100.08%	EUR	100.08%	629	1 001 389
INTNED Float 11/2014	350 000	100.34%	EUR	100.34%	228	351 404
JPM Float 09/2013	80 000	100.05%	EUR	100.05%	5	80 044
						13 451 244
						20 751 121

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						2 102 063
UPs de OIC abertos						
CXG LIQUIDEZ	212 481	5.25	EUR	5.25		1 115 229
UPs de OIC de tesouraria						
FEI CX F. MONETARIO	179 853	5.49	EUR	5.49		986 834
						2 102 063

LIQUIDEZ

À vista					176	176
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.1130%			EUR		176	176
A prazo					309 866	27 374 866
Depósitos com pré aviso e a prazo						
DP DP CGD 21/04 393d 3.0000% 2013-04-22 a 2014-05-20			EUR		11 667	2 011 667
DP DP CGD 27/06 363d 2.7500% 2013-06-27 a 2014-06-25			EUR		2 322	7 602 322
DP DP CGD 28/9 368d 2.9000% 2012-09-28 a 2013-10-01			EUR		33 350	1 533 350
DP DP CGD 21/12 364d 3.0500% 2012-12-21 a 2013-12-20			EUR		66 775	4 171 775
DP DP CGD 30/01 356d 2.9500% 2013-01-30 a 2014-01-21			EUR		7 473	607 473
DP DP CGD 30-10 395d 3.1500% 2012-10-30 a 2013-11-29			EUR		10 675	510 675
DP DP CGD 28/03 391d 3.0000% 2013-03-28 a 2014-04-23			EUR		39 583	5 039 583
DP DP CGD 31/12 354d 3.0500% 2012-12-31 a 2013-12-20			EUR		9 406	619 406
DP DP CGD 10/10 359d 3.0000% 2012-10-10 a 2013-10-04			EUR		57 200	2 657 200
DP DP CGD 01/03 378d 3.0000% 2013-03-01 a 2014-03-14			EUR		6 100	606 100
DP DP CGD 9/11 364d 3.1500% 2012-11-09 a 2013-11-08			EUR		8 190	408 190
DP DP CGD 03/07 365d 3.7500% 2012-07-03 a 2013-07-03			EUR		52 938	1 452 938
DP DP CGD 31/07 362d 3.0000% 2012-07-31 a 2013-07-28			EUR		4 188	154 188
						27 374 866
						27 375 042

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						643 895
Valores Passivos						-63 622
						580 273
						50 808 498

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 2013-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					8 905 035.30	

Valor da Unidade de Participação 5.7056 €