

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
 Composição da Carteira em 2018-04-30

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.					9 020	3 380 453
Obrigações diversas						
CXGD 3% 01/2019	600 000	102.21%	EUR	102.21%	5 227	618 481
TAGST 09-ENGY A1/25	750 512	103.26%	EUR	103.26%	625	775 604
CXGD 1% 01/2022	700 000	102.21%	EUR	102.21%	1 803	717 266
VERSE 3 SNR 02/2019	895 684	100.83%	EUR	100.83%	941	904 104
VERSE 4 SNR 02/2021	354 007	102.99%	EUR	102.99%	424	364 998
						3 380 453
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					1 176 993	153 060 609
Titulos de Dívida Pública						
FADE 0.031% 06/2020	5 400 000	100.36%	EUR	100.36%	1 463	5 420 849
Obrigações diversas						
NOSPL 1.125% 05/23	2 500 000	100.38%	EUR	100.38%		2 509 550
DAIGR Float 07/24	1 000 000	100.17%	EUR	100.17%	94	1 001 804
VW Float 07/19	1 100 000	100.19%	EUR	100.19%	17	1 102 052
BASGR Float 11/19	1 300 000	100.41%	EUR	100.41%		1 305 304
SAPGR Float 03/21	1 100 000	100.63%	EUR	100.63%		1 106 897
COFP 4.481% 11/2018	6 000 000	102.79%	EUR	102.79%	160 154	6 327 374
LGFP 5.375% 11/2018	5 000 000	103.13%	EUR	103.13%	112 654	5 268 954
COFP 5.244% 03/2020	1 000 000	107.70%	EUR	107.70%	7 615	1 084 615
PPFP 3.125% 04/2019	258 000	103.18%	EUR	103.18%	177	266 386
RENAUL 1.125% 09/19	1 200 000	101.56%	EUR	101.56%	7 878	1 226 574
MCFP 1% 09/2021	1 400 000	102.74%	EUR	102.74%	8 400	1 446 704
BPCEGP 5.1% 06/2018	1 480 000	100.79%	EUR	100.79%	7 179	1 498 834
RENAUL 3.625% 09/18	2 000 000	101.40%	EUR	101.40%	44 493	2 072 573
KERFP 1.875% 10/2018	1 500 000	100.89%	EUR	100.89%	15 796	1 529 101
BPCEGP 3.7% 05/2018	2 530 000	100.12%	EUR	100.12%	19 984	2 552 982
BNFP Float 11/18	400 000	100.12%	EUR	100.12%		400 488
RENAULT Float 08/20	100 000	100.39%	EUR	100.39%	7	100 394
BPCEGP Float 03/22	500 000	102.25%	EUR	102.25%	532	511 802
RENAULT Float 04/21	100 000	100.79%	EUR	100.79%	17	100 806
ACAFP Float 04/22	1 000 000	101.35%	EUR	101.35%	144	1 013 624
MCFP 0% 05/20	4 300 000	100.02%	EUR	100.02%		4 300 946
MCFP Float 11/18	465 000	100.16%	EUR	100.16%		465 735
BNP Float 06/24	800 000	100.94%	EUR	100.94%	517	808 021
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.88%	EUR	100.88%	183	403 691
GFCFP Float 06/22	800 000	100.08%	EUR	100.08%	37	800 645
ALDFP Float 11/20	500 000	100.26%	EUR	100.26%	89	501 384
SANFP Float 03/20	900 000	100.50%	EUR	100.50%		904 500
ABBEY 2.625% 07/2020	750 000	105.59%	EUR	105.59%	15 588	807 506
LLOYDS 1.875% 10/18	1 500 000	100.94%	EUR	100.94%	15 642	1 529 742
ABBEY 2% 01/2019	1 000 000	101.55%	EUR	101.55%	5 863	1 021 353
DGELN 1.125% 05/2019	1 000 000	101.18%	EUR	101.18%	10 664	1 022 424

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
F 1.75% 05/18	5 000 000	100.09%	EUR	100.09%	82 705	5 087 055
ABBEY 0.875% 01/2020	500 000	101.54%	EUR	101.54%	1 295	508 990
LLOYDS 0.625% 04/20	1 500 000	101.30%	EUR	101.30%	283	1 519 783
HSBC Float 09/22	750 000	101.02%	EUR	101.02%	271	757 891
F Float 08/20	300 000	100.54%	EUR	100.54%	92	301 718
WPPLN Float 05/20	800 000	100.12%	EUR	100.12%		800 992
SANUK Float 05/23	500 000	100.34%	EUR	100.34%	446	502 151
RBS Float 06/20	900 000	100.32%	EUR	100.32%	139	903 028
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	100.37%	EUR	100.37%	514	1 004 174
HSBC 0.17% 10/23	500 000	100.03%	EUR	100.03%	62	500 227
RBS Float 03/2020	100 000	100.24%	EUR	100.24%	12	100 250
TELEFO 4.693% 11/19	1 000 000	107.25%	EUR	107.25%	21 986	1 094 506
REDELE 4.875% 04/2022	1 000 000	109.80%	EUR	109.80%	267	1 098 297
CABKSM 3.125% 05/18	4 000 000	100.10%	EUR	100.10%	120 548	4 124 348
SANTAN 1.1% 07/2018	2 000 000	100.32%	EUR	100.32%	16 636	2 023 036
SANSCF Float 01/19	600 000	100.22%	EUR	100.22%	40	601 360
IBESM Float 02/24	1 100 000	100.88%	EUR	100.88%	732	1 110 439
SANTAN Float 03/22	600 000	101.90%	EUR	101.90%	472	611 860
BBVASM Float 04/22	1 200 000	101.21%	EUR	101.21%	172	1 214 644
CRUNAV Float 06/2022	500 000	99.31%	EUR	99.31%	183	496 753
VLVY 2.375% 11/26/19	250 000	103.75%	EUR	103.75%	2 538	261 905
SCANIA Float 10/18	500 000	100.11%	EUR	100.11%	2	500 572
SCANIA Float 04/20	500 000	100.25%	EUR	100.25%	11	501 281
ENIIM 4.25% 02/20	700 000	107.46%	EUR	107.46%	7 091	759 325
ISPIM 1.125% 01/2020	1 600 000	101.88%	EUR	101.88%	5 277	1 635 357
ISPIM 4.125% 04/2020	750 000	107.91%	EUR	107.91%	1 441	810 736
UCGIM 5% 05/2018	475 000	100.25%	EUR	100.25%	22 449	498 648
UCGIM 5.65% 08/2018	1 000 000	101.76%	EUR	101.76%	38 699	1 056 269
ISPIM 2% 06/2021	1 000 000	105.06%	EUR	105.06%	17 370	1 067 990
ISPIM Float 04/22	450 000	101.81%	EUR	101.81%	93	458 243
GS 5.125% 10/2019	1 200 000	107.62%	EUR	107.62%	32 014	1 323 406
BAC 2.5% 07/2020	750 000	105.43%	EUR	105.43%	14 281	804 998
JPM Float 06/2018	650 000	100.04%	EUR	100.04%		650 254
MS Float 01/22	500 000	100.73%	EUR	100.73%	21	503 691
MS Float 03/12/2019	200 000	100.21%	EUR	100.21%	55	200 483
BAC Float 02/22	200 000	100.97%	EUR	100.97%	217	202 157
BAC Float 05/23	400 000	100.74%	EUR	100.74%	427	403 387
GM Float 05/21	1 800 000	100.74%	EUR	100.74%	1 369	1 814 725
TMO Float 07/2019	1 500 000	100.18%	EUR	100.18%		1 502 685
BATSLN Float 08/21	500 000	100.21%	EUR	100.21%	177	501 212
BAC Float 09/21	500 000	99.95%	EUR	99.95%	23	499 768
GS Float 09/23	1 100 000	99.86%	EUR	99.86%	320	1 098 813
UTX Float 11/19	1 500 000	100.31%	EUR	100.31%		1 504 665
T Float 09/2023	1 500 000	102.06%	EUR	102.06%	1 242	1 532 157
CS 1.375% 11/2019	1 200 000	102.33%	EUR	102.33%	6 916	1 234 864
UBS Float 09/2019	400 000	100.50%	EUR	100.50%	110	402 110
UBS Float 04/2021	200 000	100.70%	EUR	100.70%	8	201 404

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
REPSM 4.875% 02/2019	2 500 000	103.98%	EUR	103.98%	23 707	2 623 307
IBESM 4.25% 10/2018	1 200 000	101.94%	EUR	101.94%	28 225	1 251 445
ENELIM 4.875% 03/20	1 250 000	109.03%	EUR	109.03%	8 515	1 371 327
REPSM 2.625% 05/2020	2 500 000	105.33%	EUR	105.33%	60 771	2 694 071
IBESM 2.875% 11/2020	1 000 000	107.08%	EUR	107.08%	13 469	1 084 299
RENEPL 4.75% 10/2020	1 000 000	111.43%	EUR	111.43%	25 637	1 139 947
ACHMEA 2.5% 11/2020	2 800 000	105.91%	EUR	105.91%	31 260	2 996 740
NOMURA 1.125% 06/20	1 000 000	102.02%	EUR	102.02%	10 233	1 030 403
ACHMEA 0.875% 09/18	4 000 000	100.41%	EUR	100.41%	21 671	4 037 871
ABNANV Float 01/19	600 000	100.32%	EUR	100.32%	43	601 987
MYL FLOAT 11/18	1 200 000	100.33%	EUR	100.33%	1 226	1 205 138
VW 0.5% 03/21	600 000	100.57%	EUR	100.57%	263	603 707
VW Float 03/19	600 000	100.14%	EUR	100.14%	12	600 876
BMW 0.125% 07/20	3 000 000	100.34%	EUR	100.34%	3 103	3 013 153
LPTY Float 11/20	800 000	100.45%	EUR	100.45%	363	803 971
MYL Float 05/20	800 000	100.15%	EUR	100.15%	252	801 452
PHIANA Float 09/2019	750 000	100.34%	EUR	100.34%		752 543
AKZANA Float 11/19	900 000	100.33%	EUR	100.33%		902 952
ANNGR FLOAT 11/19	500 000	100.26%	EUR	100.26%	21	501 316
ALVGR Float 12/20	300 000	101.12%	EUR	101.12%	79	303 424
LPTY Float 01/21	200 000	100.39%	EUR	100.39%	6	200 784
ADNA Float 03/21	200 000	100.26%	EUR	100.26%		200 512
DAIGR Float 04/20	300 000	100.64%	EUR	100.64%	30	301 944
TOYOTA FLT 04/27	500 000	100.42%	EUR	100.42%	1	502 121
NYKRE Float 06/22	1 000 000	100.60%	EUR	100.60%	405	1 006 445
JYBC Float 06/20	1 000 000	100.41%	EUR	100.41%	38	1 004 168
CBSBKF Float 03/21	600 000	100.43%	EUR	100.43%	156	602 730
KBCBB Float 11/22	500 000	100.75%	EUR	100.75%	197	503 947
GE 2.875% 06/2019	1 000 000	103.32%	EUR	103.32%	24 969	1 058 159
GE 2.25% 07/2020	2 000 000	104.74%	EUR	104.74%	35 137	2 129 957
DLTAS 2008-1 A	1 025 975	100.00%	EUR	100.00%	41	1 026 016
DHR Float 06/22	700 000	100.37%	EUR	100.37%		702 618
DE Float 09/20	1 000 000	100.41%	EUR	100.41%		1 004 080
SUMIBK Float 06/22	500 000	100.36%	EUR	100.36%	82	501 862
BMO Float 09/21	750 000	100.86%	EUR	100.86%	121	756 564
BNS FLOAT 10/22	1 000 000	101.34%	EUR	101.34%	196	1 013 556
ICBCAS FLOAT 10/20	1 000 000	100.16%	EUR	100.16%	117	1 001 697
BCHINA Float 11/20	300 000	100.00%	EUR	100.00%	80	300 068
AMXLMM 4.125% 10/2019	700 000	106.09%	EUR	106.09%	14 873	757 524
AMXLMM 1% 06/2018	2 500 000	100.06%	EUR	100.06%	22 671	2 524 071
GLENLN 2.625% 11/18	800 000	101.39%	EUR	101.39%	9 378	820 522
BACR Float 03/2021	900 000	96.20%	EUR	96.20%	141	865 914
GSFloat 10/2019	50 000	100.79%	EUR	100.79%	1	50 394
GS Float 09/2018	500 000	100.19%	EUR	100.19%	224	501 194
BAC Float 05/2019	700 000	101.12%	EUR	101.12%	1 847	709 659
C Float 11/2019	100 000	100.67%	EUR	100.67%	48	100 718
ANNGR Float 09/18	500 000	100.08%	EUR	100.08%	36	500 421

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
UNANA Float 06/18	500 000	100.02%	EUR	100.02%		500 110
BSN Float 09/2018	500 000	100.13%	EUR	100.13%	37	500 687
RY Float 03/2019	300 000	100.38%	EUR	100.38%	35	301 166
RY Float 10/2018	500 000	100.20%	EUR	100.20%	11	501 011
DAIGR Float 01/2019	200 000	100.30%	EUR	100.30%	21	200 625
VOD Float 02/2019	200 000	100.71%	EUR	100.71%	221	201 639
RENAUL Float 03/19	600 000	100.78%	EUR	100.78%	482	605 138
NDASS Float 02/19	200 000	100.34%	EUR	100.34%	46	200 722
CAT Float 05/2018	200 000	100.01%	EUR	100.01%		200 010
UCGIM Float 02/2020	650 000	101.34%	EUR	101.34%	861	659 565
FDX Float 04/19	300 000	100.41%	EUR	100.41%	37	301 264
CAPFP Float 07/2018	700 000	100.05%	EUR	100.05%	284	700 648
VW Float 07/2018	100 000	100.04%	EUR	100.04%		100 035
BPCEGP Float 05/2018	500 000	100.05%	EUR	100.05%	286	500 521
ISPIM Float 04/2019	600 000	100.81%	EUR	100.81%	168	605 010
ISPIM Float 06/20	200 000	101.59%	EUR	101.59%	189	203 363
NWIDE Float 11/2018	700 000	100.24%	EUR	100.24%	294	701 953
SWEDA FLOAT 08/2020	200 000	100.96%	EUR	100.96%	68	201 992
SWEDA FLOAT 03/19	200 000	100.62%	EUR	100.62%	118	201 358
						147 639 760
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					41 203	7 116 002
Obrigações diversas						
HUWY 1.375% 10/2021	2 000 000	103.35%	EUR	103.35%	13 712	2 080 732
K 1.75% 05/2021	1 000 000	104.26%	EUR	104.26%	16 397	1 059 027
KO Float 03/19	300 000	100.27%	EUR	100.27%		300 807
UBS Float 09/22	1 000 000	100.92%	EUR	100.92%	434	1 009 664
AGN Float 06/19	1 000 000	100.14%	EUR	100.14%	37	1 001 477
WESAU 1.25% 10/2021	1 500 000	103.54%	EUR	103.54%	10 582	1 563 727
AT&T Float 06/19	100 000	100.53%	EUR	100.53%	40	100 567
						7 116 002
						163 557 064
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC domiciliados em Portugal						36 909 428
CXG OBRIGAÇÕES	2 258 307	4.47	EUR	4.47		10 100 276
CXG LIQUIDEZ	5 021 569	5.34	EUR	5.34		26 809 153
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						24 919 608
AXA WF EUR SD-I-XC€	248 649	100.22	EUR	100.22		24 919 608
						61 829 036
LIQUIDEZ						
À vista						20 578 482
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			20 578 482
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
Valores Passivos						-2 746 827

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2018-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
						-2 746 827
						243 217 756

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

41 231 193,01

Valor da Unidade de Participação: € 5.8989