

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2013-09-30

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.					26 451	1 239 002
Títulos de Dívida Pública						
OT 3.6% OUT/2014	172 000	99.68%	EUR	99.68%	5 955	177 404
OT 4.375% 06/2014	130 000	100.45%	EUR	100.45%	1 667	132 252
						309 656
Obrigações diversas						
CXGD 3.625% 07/2014	200 000	100.64%	EUR	100.64%	1 430	202 716
SANTAN 3.25% 10/2014	150 000	101.00%	EUR	101.00%	4 608	156 102
BESPL 3.375% 02/15	250 000	100.31%	EUR	100.31%	5 224	256 007
BPIPL 3.25% 01/2015	100 000	100.12%	EUR	100.12%	2 306	102 430
CXGD 3.75% 01/2018	200 000	99.61%	EUR	99.61%	5 260	204 470
						921 725
Acções						
J.MARTINS-PO	502	15.18	EUR	15.18		7 620
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					97 982	23 512 682
Títulos de Dívida Pública						
DBR 6.25% 01/2024	80 000	142.08%	EUR	142.08%	3 699	117 363
DBR 4% 04/01/37	156 000	124.69%	EUR	124.69%	4 616	199 124
DBR 3.75% 01/2017	10 000	111.13%	EUR	111.13%	277	11 390
DBR 1.75% 07/04/22	63 000	101.78%	EUR	101.78%	269	64 387
DBR 1.5% 05/2023	98 000	98.00%	EUR	98.00%	560	96 600
FRTR 3.25% 25/4/2016	11 000	107.15%	EUR	107.15%	156	11 942
FRANCE O.A.T 4.25	60 000	113.42%	EUR	113.42%	2 382	70 434
FRTR 4.5% 04/2041	238 000	120.10%	EUR	120.10%	4 665	290 503
FRTR 3% 04/2022	434 000	107.26%	EUR	107.26%	5 672	471 180
SPGB 4.8% 01/2024	216 000	103.84%	EUR	103.84%	6 903	231 197
SPGB 3.15% 01/2016	90 000	102.61%	EUR	102.61%	1 887	94 232
SPGB 5.5% 04/2021	310 000	110.87%	EUR	110.87%	7 194	350 875
SPGB 3.3% 10/2014	37 000	102.22%	EUR	102.22%	1 121	38 940
BTPS 4.25% 09/2019	60 000	103.58%	EUR	103.58%	211	62 362
BTPS 5% 09/2040	213 000	99.22%	EUR	99.22%	883	212 211
BTPS 5% 03/2025	213 000	103.73%	EUR	103.73%	883	221 817
BTPS 3.75% 08/2016	580 000	103.74%	EUR	103.74%	3 605	605 268
BTPS 3% 11/2015	364 000	102.10%	EUR	102.10%	4 540	376 184
BTPS 5.5% 09/2022	185 000	108.29%	EUR	108.29%	843	201 180
NETHER 3.75% 01/23	337 000	114.51%	EUR	114.51%	8 967	394 849
BGB 3.5% 06/2017	468 000	109.20%	EUR	109.20%	4 263	515 296
RAGB 4.85 03/2026	168 000	126.13%	EUR	126.13%	4 465	216 363
CCTS Float 06/15/17	400 000	100.80%	EUR	100.80%	3 384	406 584
						5 260 282
Obrigações diversas						
BCPN Float 05/14	600 000	97.02%	EUR	97.02%	333	582 423

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2013-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ITFIN 2005-1 A2/20	4 091	98.85%	EUR	98.85%	1	4 044
NDASS 2.25% 05/2019	100 000	104.44%	EUR	104.44%	931	105 369
MAGEL 4 D 07/2059	126 478	38.00%	EUR	38.00%	192	48 254
CGD S.758 12/2017	4 050 000	80.58%	EUR	80.58%	2 840	3 266 330
CAFP Float 04/2016	300 000	100.67%	EUR	100.67%	687	302 706
SANT.CONS.FIN.Flt 16	250 000	91.19%	EUR	91.19%	7	227 977
SANTAN Float 09/2016	600 000	99.48%	EUR	99.48%	91	596 953
LLOYDS BANK Float 16	250 000	98.08%	EUR	98.08%	593	245 801
BNP Float 12/2014	130 000	100.22%	EUR	100.22%	61	130 343
JPM Float 03/2018	200 000	97.10%	EUR	97.10%	7	194 207
MS Float 04/2016	580 000	98.68%	EUR	98.68%	777	573 109
Citigroup Flt.03/14	400 000	100.01%	EUR	100.01%	105	400 145
UBS Float 05/2014	300 000	100.27%	EUR	100.27%	278	301 091
TELEFO Float 06/2015	750 000	101.05%	EUR	101.05%	1 239	759 091
SOCGEN Float 01/2015	500 000	100.32%	EUR	100.32%	724	502 299
VLVY Float 05/2016	350 000	100.43%	EUR	100.43%	459	351 964
DB Float 09/2016	400 000	97.96%	EUR	97.96%	125	391 957
NYKRE Float 01/2014	200 000	100.52%	EUR	100.52%	744	201 776
DAIGR Float 04/2015	500 000	99.94%	EUR	99.94%	515	500 203
SYDBDC Float 02/2014	100 000	100.47%	EUR	100.47%	201	100 674
GE Float 02/2016	600 000	99.37%	EUR	99.37%	250	596 476
AYTCED Float 11/2015	600 000	96.38%	EUR	96.38%	902	579 152
ENELIM Float 01/2015	400 000	99.70%	EUR	99.70%	979	399 779
ENIIMFloat 10/2017	415 000	107.77%	EUR	107.77%	6 238	453 475
BAVB Float 10/14	50 000	99.05%	EUR	99.05%	54	49 578
JYBC Float 05/2015	300 000	101.19%	EUR	101.19%	464	304 019
UCGIM Float 01/2016	600 000	99.75%	EUR	99.75%	2 035	600 523
UCGIM Float 07/15	200 000	96.81%	EUR	96.81%	178	193 790
UBIIM Float 07/2014	500 000	99.16%	EUR	99.16%	380	496 190
UBIIM Float 12/2014	300 000	98.10%	EUR	98.10%	276	294 564
RABOBK Float 04/2015	100 000	100.11%	EUR	100.11%	83	100 196
ACAFP Float 01/2015	200 000	100.17%	EUR	100.17%	268	200 616
LANISL Float 05/2012	200 000	8.00%	EUR	8.00%		16 000
BPCEGP Float 12/2014	400 000	100.19%	EUR	100.19%	195	400 975
ISPIM Float 07/2015	800 000	100.16%	EUR	100.16%	2 453	803 701
Intned Float 04/2016	400 000	99.00%	EUR	99.00%	380	396 368
INTNED Float 11/2014	500 000	100.34%	EUR	100.34%	338	502 053
DANBNK Float 03/2014	200 000	100.42%	EUR	100.42%	122	200 956
BMW Float 09/2016	100 000	99.95%	EUR	99.95%	33	99 984
						16 475 110
Acções						
BMW	520	79.47	EUR	79.47		41 324
DEUTSCHE BANK	1 419	33.94	EUR	33.94		48 161
SIEMENS	913	89.06	EUR	89.06		81 312
ALLIANZ	552	116.20	EUR	116.20		64 142

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2013-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 375	13.15	EUR	13.15		18 081
BASF	882	70.90	EUR	70.90		62 534
BAYER AG	600	87.16	EUR	87.16		52 296
MUNCHENER RUCKVERS.	255	144.45	EUR	144.45		36 835
ADIDAS- SALOMON AG	372	80.18	EUR	80.18		29 827
BEIERSDORF AG	415	65.64	EUR	65.64		27 241
HENKEL KGAA PREF.	371	76.17	EUR	76.17		28 259
SAP ORD.	550	54.67	EUR	54.67		30 069
THYSSEN KRUPP	1 198	17.68	EUR	17.68		21 181
FRESENIUS MEDICAL CA	245	48.09	EUR	48.09		11 782
VOLKSWAGEN AG-PREF.	274	174.25	EUR	174.25		47 745
GEN DES EAUX/VIVENDI	1 193	17.01	EUR	17.01		20 287
DANONE	575	55.64	EUR	55.64		31 993
AXA-UAP	1 238	17.13	EUR	17.13		21 201
CARREFOUR	364	25.38	EUR	25.38		9 237
TOTAL SA	1 724	42.90	EUR	42.90		73 951
Kering	59	165.65	EUR	165.65		9 773
BNP	616	50.00	EUR	50.00		30 800
AIR LIQUIDE	145	102.95	EUR	102.95		14 928
SCHNEIDER	553	62.51	EUR	62.51		34 568
L.V.M.H.	116	145.60	EUR	145.60		16 890
MICHELIN	184	81.97	EUR	81.97		15 082
RENAULT SA	389	58.93	EUR	58.93		22 924
SOCIETE GENERALE	901	36.83	EUR	36.83		33 184
GLE ENTREP. VINCI	1 067	42.97	EUR	42.97		45 849
SANOFI SYNHLABO	968	74.97	EUR	74.97		72 571
EADS	828	47.10	EUR	47.10		38 995
GAZ DE FRANCE	628	18.57	EUR	18.57		11 662
SUEZ ENVIRONNEMENT S	1 349	11.99	EUR	11.99		16 175
EDF	429	23.38	EUR	23.38		10 030
LLOYDS BANK	12 121	0.74	GBP	0.88		10 668
BARCLAYS	5 331	2.66	GBP	3.18		16 929
DE LA RUE PLC	384	9.94	GBP	11.88		4 563
AFREN PLC	6 303	1.38	GBP	1.65		10 426
JAZZTEL PLC	1 931	8.03	EUR	8.03		15 508
TELEFONICA	3 837	11.51	EUR	11.51		44 164
BCO SANTANDER C.HISP	9 224	6.03	EUR	6.03		55 602
IBERDROLA	3 815	4.30	EUR	4.30		16 385
REPSOL	1 359	18.33	EUR	18.33		24 904
BCO. BILBAO VISCAYA	3 802	8.26	EUR	8.26		31 405
FERROVIAL	2 043	13.29	EUR	13.29		27 151
DISTR.IINTERNACIONAL	1 527	6.41	EUR	6.41		9 787
UNICREDITO ITALIANO	2 279	4.71	EUR	4.71		10 739
ENI SPA	1 845	16.95	EUR	16.95		31 273
BANCA INTESA	12 745	1.53	EUR	1.53		19 436
FINMECCANICA	2 450	4.42	EUR	4.42		10 834

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA

Composição da Carteira em 2013-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
TERNA SPA	3 325	3.34	EUR	3.34		11 092
ING GROEP NV	4 018	8.35	EUR	8.35		33 554
UNILEVER NV-CVA	858	28.76	EUR	28.76		24 672
ASML NA	356	73.00	EUR	73.00		25 988
AKZO NOBEL NV NLG20	528	48.58	EUR	48.58		25 648
NOKIA A	4 416	4.86	EUR	4.86		21 453
UPM-KYMMENE	1 991	10.23	EUR	10.23		20 368
Neste Oil Oyj	647	16.35	EUR	16.35		10 578
SOLVAY SA	154	110.85	EUR	110.85		17 071
ANHEUSER-BUSCH INB	956	73.58	EUR	73.58		70 342
BELGACOM SA	1 219	19.65	EUR	19.65		23 953
OMV AG	344	36.50	EUR	36.50		12 556
CRH ORD	457	17.66	EUR	17.66		8 068
						1 776 004
Direitos						
BARCLAYS Drts Subs	1 332	0.81	GBP	0.97		1 287
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU						81 418
Acções						
NOVARTIS REG	320	69.50	CHF	56.85		18 192
C.S.HOLD./GROUP-REG	493	27.62	CHF	22.59		11 138
C.FIN.RICHMONT	377	90.60	CHF	74.11		27 940
MARINE HARVEST	30 520	6.42	NOK	0.79		24 148
						81 418
						24 833 103
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC domiciliados em Portugal						2 493 779
UPs de OIC abertos						
CXG OB MAIS MENSAL	415 859	4.19	EUR	4.19		1 742 241
FEI CX F. MONETARIO	136 489	5.51	EUR	5.51		751 538
						2 493 779
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						4 383 454
UPs de OIC harmonizados						
HSBC EURO GVT BOND F	190	2 816.63	EUR	2 816.63		535 160
PETERCAM BdEUR InG-F	19 945	57.58	EUR	57.58		1 148 433
BROCK EURO MKT Fd D2	35 572	22.35	EUR	22.35		795 034
BNPP L1 EQTY EURO I	2 541	310.50	EUR	310.50		788 981
PIONEER EUROLND EQ I	79 034	6.54	EUR	6.54		516 882
ROBECO EUR GOV BD I	1 640	139.19	EUR	139.19		228 272
ALLIANZ EUOLD EQY G	165	1 617.80	EUR	1 617.80		266 937
SEAYOND EUR MIN VAR	4	13 020.04	EUR	13 020.04		52 080
ISHARES EUROP MINVOL	1 875	27.56	EUR	27.56		51 675
						4 383 454

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA ACTIVA
 Composição da Carteira em 2013-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
OIC domici. em Estados não membros da EU						49 860
UPs de OIC						
TISHMAN ESOF	91 579	0.54	EUR	0.54		49 860
						6 927 093
Outros Ativos da Carteira						
Imovéis						
R Rodrigo Fonseca	5	594 400.00	EUR	594 400.00		2 972 000
REPUBLICA 35- R/C	8	553 625.00	EUR	553 625.00		4 429 000
						7 401 000
						7 401 000
LIQUIDEZ						
À vista					46	46
Depósitos à ordem						
DO DO CGD - EUR 0.1032%			EUR		46	46
A prazo					41 658	2 516 658
Depósitos com pré aviso e a prazo						
DP DP CGD 10/10 359d 3.0000% 2012-10-10 a 2013-10-04			EUR		13 350	463 350
DP DP CGD 31/12 354d 3.0500% 2012-12-31 a 2013-12-20			EUR		11 607	511 607
DP DP CGD 21/12 364d 3.0500% 2012-12-21 a 2013-12-20			EUR		4 812	204 812
DP DP CGD 9/11 364d 3.1500% 2012-11-09 a 2013-11-08			EUR		2 853	102 853
DP DP CGD 27/09 364d 2.7500% 2013-09-27 a 2014-09-26			EUR		244	800 244
DP DP CGD 28/12 357d 3.0500% 2012-12-28 a 2013-12-20			EUR		2 347	102 347
DP DP CGD 01/02 354d 2.9500% 2013-02-01 a 2014-01-21			EUR		6 445	331 445
						2 516 658
						2 516 704
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
Valores Activos						774 735
Valores Passivos						-151 626
						796 330
						42 301 009
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE COTAÇÕES						
Futuros						
VGZ3-EUR EUX12/2013			EUR			173 220
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					3 457 761.99	
Valor da Unidade de Participação						12.2336 €