

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
 Composição da Carteira em 2018-06-30

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.					4 764	2 536 984
Obrigações diversas						
TAGST 09-ENGY A1/25	733 093	102.85%	EUR	102.85%	611	754 597
CXGD 1% 01/2022	700 000	102.30%	EUR	102.30%	2 973	719 073
VERSE 3 SNR 02/2019	717 733	100.44%	EUR	100.44%	754	721 652
VERSE 4 SNR 02/2021	333 848	102.21%	EUR	102.21%	427	341 663
						2 536 984
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					681 813	101 241 288
Titulos de Dívida Pública						
FADE 0.031% 06/2020	5 400 000	100.25%	EUR	100.25%	64	5 413 348
Obrigações diversas						
NOSPL 1.125% 05/23	2 500 000	100.64%	EUR	100.64%	4 623	2 520 648
DAIGR Float 07/24	1 000 000	99.08%	EUR	99.08%	299	991 069
BASGR Float 11/19	1 300 000	100.30%	EUR	100.30%		1 303 900
SAPGR Float 03/21	1 100 000	100.45%	EUR	100.45%		1 104 994
COFP 4.481% 11/2018	6 000 000	101.62%	EUR	101.62%	217 621	6 314 641
COFP 5.244% 03/2020	1 000 000	105.13%	EUR	105.13%	16 379	1 067 659
RENAUL 1.125% 09/19	1 200 000	101.31%	EUR	101.31%	10 134	1 225 890
MCFP 1% 09/2021	1 400 000	102.90%	EUR	102.90%	10 740	1 451 396
RENAULT Float 08/20	100 000	100.13%	EUR	100.13%	28	100 155
BPCEGP Float 03/22	500 000	101.20%	EUR	101.20%	203	506 178
RENAULT Float 04/21	100 000	100.30%	EUR	100.30%	71	100 373
ACAFP Float 04/22	1 000 000	100.31%	EUR	100.31%	944	1 004 044
MCFP 0% 05/20	4 300 000	100.17%	EUR	100.17%		4 307 353
BNP Float 06/24	800 000	99.25%	EUR	99.25%	228	794 236
RENAUL Float 03/2022	400 000	99.85%	EUR	99.85%	66	399 474
GFCFP Float 06/22	800 000	99.75%	EUR	99.75%	2	798 034
ALDFP Float 11/20	500 000	100.02%	EUR	100.02%	50	500 165
SANFP Float 03/20	900 000	100.39%	EUR	100.39%		903 492
BNP Float 05/23	500 000	99.04%	EUR	99.04%	163	495 343
ABBAY 2.625% 07/2020	750 000	105.12%	EUR	105.12%	18 878	807 308
ABBAY 0.875% 01/2020	500 000	101.29%	EUR	101.29%	2 026	508 461
LLOYDS 0.625% 04/20	1 500 000	101.21%	EUR	101.21%	1 849	1 520 029
HSBC Float 09/22	750 000	100.38%	EUR	100.38%	31	752 874
F Float 08/20	300 000	100.21%	EUR	100.21%	49	300 691
WPPLN Float 05/20	800 000	100.04%	EUR	100.04%		800 352
SANUK Float 05/23	500 000	99.54%	EUR	99.54%	277	497 987
RBS Float 06/20	900 000	99.97%	EUR	99.97%	63	899 829
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	99.29%	EUR	99.29%	127	993 037
HSBC 0.17% 10/23	500 000	99.29%	EUR	99.29%	208	496 673
RBS Float 03/2020	100 000	99.97%	EUR	99.97%	6	99 976
GSK Float 05/20	500 000	100.34%	EUR	100.34%		501 680
TELEFO 4.693% 11/19	1 000 000	106.26%	EUR	106.26%	29 829	1 092 419

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
REDELE 4.875% 04/202	1 000 000	108.80%	EUR	108.80%	8 414	1 096 444
IBESM Float 02/24	1 100 000	100.74%	EUR	100.74%	431	1 108 593
SANTAN Float 03/22	600 000	100.90%	EUR	100.90%	116	605 504
CRUNAV Float 06/2022	500 000	99.87%	EUR	99.87%	45	499 405
VLVY 2.375% 11/26/19	250 000	103.34%	EUR	103.34%	3 530	261 885
SCANIA Float 04/20	500 000	100.20%	EUR	100.20%	72	501 077
ENIIM 4.25% 02/20	700 000	106.55%	EUR	106.55%	12 063	757 878
ISPIM 1.125% 01/2020	1 600 000	100.51%	EUR	100.51%	8 285	1 616 493
ISPIM 4.125% 04/2020	750 000	105.79%	EUR	105.79%	6 611	800 051
UCGIM 5.65% 08/2018	1 000 000	100.78%	EUR	100.78%	48 141	1 055 971
ISPIM 2% 06/2021	1 000 000	102.65%	EUR	102.65%	712	1 027 222
ISPIM Float 04/22	450 000	97.73%	EUR	97.73%	568	440 348
GS 5.125% 10/2019	1 200 000	106.71%	EUR	106.71%	42 292	1 322 752
BAC 2.5% 07/2020	750 000	105.08%	EUR	105.08%	17 414	805 522
MS Float 01/22	500 000	100.24%	EUR	100.24%	336	501 541
MS Float 03/12/2019	200 000	100.13%	EUR	100.13%	27	200 289
BAC Float 02/22	200 000	100.66%	EUR	100.66%	144	201 468
BAC Float 05/23	400 000	100.26%	EUR	100.26%	291	401 319
GM Float 05/21	1 800 000	100.48%	EUR	100.48%	915	1 809 501
BATSLN Float 08/21	500 000	99.89%	EUR	99.89%	111	499 571
BAC Float 09/21	500 000	99.75%	EUR	99.75%	7	498 777
GS Float 09/23	1 100 000	98.73%	EUR	98.73%	45	1 086 042
UTX Float 11/19	1 500 000	100.17%	EUR	100.17%		1 502 580
T Float 09/2023	1 500 000	101.10%	EUR	101.10%	595	1 517 110
MS Float 05/21	500 000	99.82%	EUR	99.82%	42	499 147
CS 1.375% 11/2019	1 200 000	102.04%	EUR	102.04%	9 674	1 234 178
UBS Float 04/2021	200 000	100.42%	EUR	100.42%	66	200 906
ENELIM 4.875% 03/20	1 250 000	108.16%	EUR	108.16%	18 699	1 370 736
REPSM 2.625% 05/2020	2 500 000	104.77%	EUR	104.77%	6 113	2 625 288
IBESM 2.875% 11/2020	1 000 000	106.59%	EUR	106.59%	18 274	1 084 214
RENEPL 4.75% 10/2020	1 000 000	110.33%	EUR	110.33%	33 575	1 136 895
ACHMEA 2.5% 11/2020	2 800 000	105.60%	EUR	105.60%	42 959	2 999 619
NOMURA 1.125% 06/20	1 000 000	101.94%	EUR	101.94%	863	1 020 283
MYL FLOAT 11/18	1 200 000	100.23%	EUR	100.23%	725	1 203 509
BMW 0.125% 07/20	3 000 000	100.24%	EUR	100.24%	3 729	3 010 929
LPTY Float 11/20	800 000	100.29%	EUR	100.29%	246	802 550
MYL Float 05/20	800 000	100.13%	EUR	100.13%	149	801 189
AKZANA Float 11/19	900 000	100.21%	EUR	100.21%		901 890
ANNGR FLOAT 11/19	500 000	100.14%	EUR	100.14%	14	500 729
ALVGR Float 12/20	300 000	100.94%	EUR	100.94%	36	302 850
LPTY Float 01/21	200 000	100.27%	EUR	100.27%	64	200 604
ADNA Float 03/21	200 000	99.98%	EUR	99.98%		199 960
DAIGR Float 04/20	300 000	100.45%	EUR	100.45%	117	301 464
TOYOTA FLT 04/27	500 000	100.35%	EUR	100.35%	20	501 770
BAYNGR 0.625% 12/22	100 000	100.47%	EUR	100.47%	9	100 482
BAYNGR Float 06/22	300 000	100.36%	EUR	100.36%	9	301 098
NYKRE Float 06/22	1 000 000	100.05%	EUR	100.05%	187	1 000 727

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
JYBC Float 06/20	1 000 000	100.25%	EUR	100.25%	22	1 002 472
MINGNO 0.75% 03/23	2 000 000	99.88%	EUR	99.88%		1 997 500
CBSBKF Float 03/21	600 000	100.28%	EUR	100.28%	69	601 755
KBCBB Float 11/22	500 000	99.48%	EUR	99.48%	119	497 509
GE 2.25% 07/2020	2 000 000	104.55%	EUR	104.55%	42 658	2 133 638
DLTAS 2008-1 A	993 396	99.61%	EUR	99.61%	45	989 546
DHR Float 06/22	700 000	100.01%	EUR	100.01%		700 084
DE Float 09/20	1 000 000	100.18%	EUR	100.18%		1 001 820
SUMIBK Float 06/22	500 000	99.65%	EUR	99.65%	30	498 295
BMO Float 09/21	550 000	100.45%	EUR	100.45%	11	552 486
BNS FLOAT 10/22	1 000 000	100.84%	EUR	100.84%	657	1 009 087
ICBCAS FLOAT 10/20	1 000 000	99.98%	EUR	99.98%	491	1 000 251
BCHINA Float 11/20	300 000	99.92%	EUR	99.92%	48	299 796
AMXLMM 4.125%10/2019	700 000	105.39%	EUR	105.39%	19 698	757 414
PEMEX Float 08/23	200 000	100.42%	EUR	100.42%	438	201 268
GLENLN 2.625% 11/18	800 000	100.81%	EUR	100.81%	12 888	819 360
BACR Float 03/2021	900 000	97.11%	EUR	97.11%	33	873 987
GSFloat 10/2019	50 000	100.62%	EUR	100.62%	36	50 348
BAC Float 05/2019	700 000	100.83%	EUR	100.83%	1 233	707 057
C Float 11/2019	100 000	100.51%	EUR	100.51%	32	100 546
RY Float 03/2019	300 000	100.27%	EUR	100.27%	4	300 823
RY Float 10/2018	500 000	100.12%	EUR	100.12%	98	500 693
UCGIM Float 02/2020	650 000	100.06%	EUR	100.06%	499	650 882
ISPIM Float 04/2019	600 000	100.09%	EUR	100.09%	901	601 429
ISPIM Float 06/20	200 000	99.78%	EUR	99.78%	65	199 623
SWEDA FLOAT 08/2020	200 000	100.75%	EUR	100.75%	43	201 549
						95 827 940
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					34 001	6 000 070
Obrigações diversas						
HUWY 1.375% 10/2021	2 000 000	103.37%	EUR	103.37%	18 308	2 085 748
K 1.75% 05/2021	1 000 000	104.24%	EUR	104.24%	1 822	1 044 192
F Float 05/21	300 000	99.67%	EUR	99.67%	40	299 059
UBS Float 09/22	1 000 000	100.08%	EUR	100.08%	115	1 000 865
WESAU 1.25% 10/2021	1 500 000	103.77%	EUR	103.77%	13 716	1 570 206
						6 000 070
						109 778 343

OUTROS VALORES

Outros Intrumentos de Dívida					75	5 050 075
Papel Comercial						
PC P.COM.C.AMORIM 6ªEM. 0.0800% 2018-06-29 a 2018-07-13			EUR		2	350 002
PC P.COM.UNILEVER 52ªEM 0.0600% 2018-06-14 a 2018-07-16			EUR		71	2 500 071
PC P.COM.C.AMORIM 5ªEM. 0.0800% 2018-06-29 a 2018-07-31			EUR		3	600 003
PC P.COM.SONAE 876ª EM. 0.0600% 2018-07-02 a 2018-07-16			EUR			1 600 000
						5 050 075
						5 050 075

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2018-06-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC domiciliados em Portugal						36 794 946
CXG OBRIGAÇÕES	2 258 307	4.45	EUR	4.45		10 044 044
CXG LIQUIDEZ	5 021 569	5.33	EUR	5.33		26 750 902
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						24 797 770
AXA WF EUR SD-I-XC€	248 649	99.73	EUR	99.73		24 797 770
						61 592 716
LIQUIDEZ						
À vista						27 178 201
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			27 168 201
DO SANTANDER - 0.0000%			EUR			5 000
DO BCP - EUR 0.0000%			EUR			5 000
						27 178 201
A prazo					4 160	37 004 160
Depósitos com pré aviso e a prazo						
DP DP BCP 05JUN 365D 0.1200% 2018-06-05 a 2019-06-05			EUR		1 300	15 001 300
DP DP SANTANDER 05JUN 0.1800% 2018-06-05 a 2019-06-05			EUR		2 860	22 002 860
						37 004 160
						64 182 361
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
Valores Passivos						-3 576 571
						-3 576 571
						237 026 925
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					40 285 273.67	

Valor da Unidade de Participação: € 5.8837