

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR
 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.					5 524	271 281
Títulos de Dívida Pública						
OT 3.6% OUT/2014	31 000	99.68%	EUR	99.68%	1 073	31 974
OT 4.375% 06/2014	28 000	100.45%	EUR	100.45%	359	28 485
						60 459
Obrigações diversas						
CXGD 3.625% 07/2014	50 000	100.64%	EUR	100.64%	358	50 679
SANTAN 3.25% 10/2014	50 000	101.00%	EUR	101.00%	1 536	52 034
BESPL 3.375% 02/15	50 000	100.31%	EUR	100.31%	1 045	51 201
BPIPL 3.25% 01/2015	50 000	100.12%	EUR	100.12%	1 153	51 215
						205 129
Acções						
J.MARTINS-PO	375	15.18	EUR	15.18		5 693
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					19 926	3 839 719
Títulos de Dívida Pública						
DBR 6.25% 01/2024	35 000	142.08%	EUR	142.08%	1 618	51 346
DBR 4% 04/01/37	35 000	124.69%	EUR	124.69%	1 036	44 675
DBR 3.75% 01/2017	48 000	111.13%	EUR	111.13%	1 332	54 672
DBR 1.75% 07/04/22	38 000	101.78%	EUR	101.78%	162	38 837
FRTR 3.25% 25/4/2016		107.15%	EUR	107.15%	-340	-340
FRTR 4.25% 10/2023	23 000	116.37%	EUR	116.37%	913	27 678
FRANCE O.A.T 4.25	26 000	113.42%	EUR	113.42%	1 032	30 522
FRTR 4.5% 04/2041	57 000	120.10%	EUR	120.10%	1 117	69 574
FRTR 3% 04/2022	86 000	107.26%	EUR	107.26%	1 124	93 367
SPGB 4.8% 01/2024	67 000	103.84%	EUR	103.84%	2 141	71 714
SPGB 5.5% 04/2021	57 000	110.87%	EUR	110.87%	1 323	64 516
SPGB 3.3% 10/2014	31 000	102.22%	EUR	102.22%	939	32 626
BTPS 5% 09/2040	48 000	99.22%	EUR	99.22%	199	47 822
BTPS 5% 03/2025	48 000	103.73%	EUR	103.73%	199	49 987
BTPS 3.75% 08/2016	115 000	103.74%	EUR	103.74%	715	120 010
BTPS 3% 11/2015	41 000	102.10%	EUR	102.10%	511	42 372
BTPS 5.5% 09/2022	78 000	108.29%	EUR	108.29%	356	84 822
NETHER 3.75% 01/23	74 000	114.51%	EUR	114.51%	1 969	86 703
BGB 3.5% 06/2017	97 000	109.20%	EUR	109.20%	884	106 803
RAGB 4.85 03/2026	40 000	126.13%	EUR	126.13%	1 063	51 515
CCTS Float 06/15/17	50 000	100.80%	EUR	100.80%	423	50 823
						1 220 044
Obrigações diversas						
BCPN Float 05/14	10 000	97.02%	EUR	97.02%	6	9 707
CGD S.758 12/2017	650 000	80.58%	EUR	80.58%	456	524 226
CXGD 8% 09/2015	32 000	106.66%	EUR	106.66%	21	34 153
UAB S.11 10/2013	57 408	91.01%	EUR	91.01%	32	52 280

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2013-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
SANTAN Float 09/2016	50 000	99.48%	EUR	99.48%	8	49 746
LLOYDS BANK Float 16	50 000	98.08%	EUR	98.08%	119	49 160
BNP Float 12/2014	50 000	100.22%	EUR	100.22%	23	50 132
MS Float 04/2016	50 000	98.68%	EUR	98.68%	67	49 406
BAC Float 05/2016	50 000	99.13%	EUR	99.13%	25	49 591
Citigroup Flt.03/14	50 000	100.01%	EUR	100.01%	13	50 018
UBS Float 05/2014	20 000	100.27%	EUR	100.27%	19	20 073
TELEFO Float 06/2015	50 000	101.05%	EUR	101.05%	83	50 606
DB Float 09/2016	15 000	97.96%	EUR	97.96%	5	14 698
GE Float 02/2016	55 000	99.37%	EUR	99.37%	23	54 677
ENELIM Float 01/2015	50 000	99.70%	EUR	99.70%	122	49 972
ENELIM Float 02/2016	30 000	98.67%	EUR	98.67%	32	29 632
BAVB Float 10/14	30 000	99.05%	EUR	99.05%	32	29 747
UCGIM Float 02/2014	30 000	99.86%	EUR	99.86%	18	29 977
UBIIM Float 07/2014	50 000	99.16%	EUR	99.16%	38	49 619
Intned Float 03/2016	15 000	96.88%	EUR	96.88%	5	14 536
Intned Float 04/2016	50 000	99.00%	EUR	99.00%	47	49 546
BMW Float 09/2016	50 000	99.95%	EUR	99.95%	17	49 992
						1 361 494
Acções						
BMW	365	79.47	EUR	79.47		29 007
DEUTSCHE BANK	1 002	33.94	EUR	33.94		34 008
SIEMENS	656	89.06	EUR	89.06		58 423
ALLIANZ	401	116.20	EUR	116.20		46 596
E.ON AG(EX VEBA AG)	1 002	13.15	EUR	13.15		13 176
BASF	620	70.90	EUR	70.90		43 958
BAYER AG	414	87.16	EUR	87.16		36 084
MUNCHENER RUCKVERS.	180	144.45	EUR	144.45		26 001
ADIDAS- SALOMON AG	262	80.18	EUR	80.18		21 007
BEIERSDORF AG	292	65.64	EUR	65.64		19 167
HENKEL KGAA PREF.	259	76.17	EUR	76.17		19 728
SAP ORD.	389	54.67	EUR	54.67		21 267
THYSSEN KRUPP	841	17.68	EUR	17.68		14 869
FRESENIUS MEDICAL CA	219	48.09	EUR	48.09		10 532
VOLKSWAGEN AG-PREF.	197	174.25	EUR	174.25		34 327
GEN DES EAUX/VIVENDI	839	17.01	EUR	17.01		14 267
DANONE	404	55.64	EUR	55.64		22 479
AXA-UAP	874	17.13	EUR	17.13		14 967
CARREFOUR	256	25.38	EUR	25.38		6 496
TOTAL SA	1 247	42.90	EUR	42.90		53 490
Kering	42	165.65	EUR	165.65		6 957
BNP	435	50.00	EUR	50.00		21 750
AIR LIQUIDE	101	102.95	EUR	102.95		10 398
SCHNEIDER	389	62.51	EUR	62.51		24 316
L.V.M.H.	81	145.60	EUR	145.60		11 794
MICHELIN	129	81.97	EUR	81.97		10 574
RENAULT SA	274	58.93	EUR	58.93		16 147

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA VALOR

Composição da Carteira em 2013-09-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
SOCIETE GENERALE	637	36.83	EUR	36.83		23 461
GLE ENTREP. VINCI	787	42.97	EUR	42.97		33 817
SANOFI SYNHLABO	671	74.97	EUR	74.97		50 305
EADS	584	47.10	EUR	47.10		27 503
GAZ DE FRANCE	444	18.57	EUR	18.57		8 245
SUEZ ENVIRONNEMENT S	721	11.99	EUR	11.99		8 645
EDF	275	23.38	EUR	23.38		6 430
LLOYDS BANK	8 519	0.74	GBP	0.88		7 497
BARCLAYS	3 792	2.66	GBP	3.18		12 042
DE LA RUE PLC	269	9.94	GBP	11.88		3 197
AFREN PLC	5 277	1.38	GBP	1.65		8 729
JAZZTEL PLC	1 357	8.03	EUR	8.03		10 898
TELEFONICA	2 648	11.51	EUR	11.51		30 478
BCO SANTANDER C.HISP	6 483	6.03	EUR	6.03		39 080
IBERDROLA	2 683	4.30	EUR	4.30		11 523
REPSOL	883	18.33	EUR	18.33		16 181
BCO. BILBAO VISCAYA	2 686	8.26	EUR	8.26		22 186
FERROVIAL	1 487	13.29	EUR	13.29		19 762
DISTR.IINTERNACIONAL	1 074	6.41	EUR	6.41		6 883
UNICREDITO ITALIANO	1 589	4.71	EUR	4.71		7 487
ENI SPA	1 298	16.95	EUR	16.95		22 001
BANCA INTESA	9 044	1.53	EUR	1.53		13 792
FINMECCANICA	1 724	4.42	EUR	4.42		7 624
TERNA SPA	2 316	3.34	EUR	3.34		7 726
ING GROEP NV	2 824	8.35	EUR	8.35		23 583
UNILEVER NV-CVA	599	28.76	EUR	28.76		17 224
ASML NA	249	73.00	EUR	73.00		18 177
AKZO NOBEL NV NLG20	372	48.58	EUR	48.58		18 070
NOKIA A	3 120	4.86	EUR	4.86		15 157
UPM-KYMMENE	1 401	10.23	EUR	10.23		14 332
Neste Oil Oyj	455	16.35	EUR	16.35		7 439
SOLVAY SA	109	110.85	EUR	110.85		12 083
ANHEUSER-BUSCH INB	714	73.58	EUR	73.58		52 536
BELGACOM SA	858	19.65	EUR	19.65		16 860
OMV AG	219	36.50	EUR	36.50		7 994
CRH ORD	370	17.66	EUR	17.66		6 532
						1 257 266
Direitos						
BARCLAYS Drts Subs	948	0.81	GBP	0.97		916
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU						57 157
Acções						
NOVARTIS REG	225	69.50	CHF	56.85		12 791
C.S.HOLD./GROUP-REG	347	27.62	CHF	22.59		7 840
C.FIN.RICHMONT	264	90.60	CHF	74.11		19 565
MARINE HARVEST	21 436	6.42	NOK	0.79		16 961
						57 157

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
						4 168 157
OUTROS VALORES						
Val. Mobiliários Nacionais não Cotados						258 908
UPs de fundos de investimento fechados						
F.I.IMOB.IMOSOCIAL	16 827	6.36	EUR	6.36		107 035
IBERIA F.INV.IMOB	4 595	0.00	EUR	0.00		3
FUNDIESTAMO I	58	1 023.67	EUR	1 023.67		59 373
LOGISTICA E DISTRIB.	16 788	5.51	EUR	5.51		92 497
						258 908
						258 908
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC domiciliados em Portugal						571 986
UPs de OIC abertos						
CXG OB MAIS MENSAL	37 127	4.19	EUR	4.19		155 542
CXG IMOBILIARIO	53 412	3.27	EUR	3.27		174 609
FEI CX F. MONETARIO	29 495	5.51	EUR	5.51		162 406
Fnd I.Imob. MAXIRENT	7 207	11.02	EUR	11.02		79 429
						571 986
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						1 958 817
UPs de OIC harmonizados						
HSBC EURO GVT BOND F	66	2 816.63	EUR	2 816.63		185 898
PETERCAM BdEUR InG-F	5 700	57.58	EUR	57.58		328 206
BROCK EURO MKT Fd D2	17 523	22.35	EUR	22.35		391 639
BNPP L1 EQTY EURO I	1 229	310.50	EUR	310.50		381 605
PIONEER EUROLND EQ I	51 237	6.54	EUR	6.54		335 090
ROBECO EUR GOV BD I	770	139.19	EUR	139.19		107 176
ALLIANZ EUOLD EQY G	120	1 617.80	EUR	1 617.80		194 136
SEYOND EUR MIN VAR	1	13 020.04	EUR	13 020.04		13 020
ISHARES EUROP MINVOL	800	27.56	EUR	27.56		22 048
						1 958 817
						2 530 803
LIQUIDEZ						
À vista					9	9
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.1032%			EUR		9	9
A prazo					28 826	1 716 826
Depósitos com pré aviso e a prazo						
DP DP CGD 4/7 368D 2.7500% 2013-07-04 a 2014-07-07			EUR		1 156	171 156
DP DP CGD 01/02 354d 2.9500% 2013-02-01 a 2014-01-21			EUR		1 448	74 448
DP DP CGD 27/06 363d 2.7500% 2013-06-27 a 2014-06-25			EUR		1 833	251 833
DP DP CGD 29/07 365d 2.7500% 2013-07-29 a 2014-07-29			EUR		391	80 391
DP DP CGD 28/9 368d 2.9000% 2012-09-28 a 2013-10-01			EUR		2 964	102 964

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
DP DP CGD 30-10 395d 3.1500% 2012-10-30 a 2013-11-29			EUR		882	30 882
DP DP CGD 28/03 391d 3.0000% 2013-03-28 a 2014-04-23			EUR		2 493	162 493
DP DP CGD 27/09 364d 2.7500% 2013-09-27 a 2014-09-26			EUR		38	125 038
DP DP CGD 21/12 364d 3.0500% 2012-12-21 a 2013-12-20			EUR		11 429	486 429
DP DP CGD 10/10 359d 3.0000% 2012-10-10 a 2013-10-04			EUR		4 450	154 450
DP DP CGD 31/12 354d 3.0500% 2012-12-31 a 2013-12-20			EUR		1 741	76 741
						1 716 826
						1 716 835
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
Valores Activos						127 943
Valores Passivos						-26 533
						101 410
						8 776 113

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

1 612 719.56

Valor da Unidade de Participação 5.4418 €