

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
 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.					70 724	2 859 040
Títulos de Dívida Pública						
OT 3.6% OUT/2014	40 000	99.88%	EUR	99.88%	1 385	41 335
Obrigações diversas						
SANTAN 3.25% 10/2014	350 000	98.69%	EUR	98.69%	10 752	356 184
BPIPL 3.25% 01/2015	1 400 000	100.33%	EUR	100.33%	32 286	1 436 902
CXGD 3.75% 01/2018	1 000 000	99.83%	EUR	99.83%	26 301	1 024 618
						2 817 704
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					265 381	17 369 808
Títulos de Dívida Pública						
BTNS 2.5% 01/2014	46 000	100.37%	EUR	100.37%	825	46 995
SPGB 3.75% 10/2015	250 000	101.62%	EUR	101.62%	8 604	262 644
BTPS 3.75% 12/2013	82 000	100.28%	EUR	100.28%	907	83 136
CCTS Float 06/15/17	230 000	100.80%	EUR	100.80%	1 946	233 786
CCTS Float 12/15	600 000	98.37%	EUR	98.37%	2 016	592 206
BGB Float 02/2016	350 000	101.25%	EUR	101.25%	377	354 755
						1 573 522
Obrigações diversas						
ACACB 3.5% 07/2014	2 000 000	100.57%	EUR	100.57%	13 808	2 025 289
CAIX.GALI 3% 11/2014	1 000 000	99.59%	EUR	99.59%	27 288	1 023 189
CAJAMM 4.375%11/15	500 000	100.24%	EUR	100.24%	18 290	519 493
SANTAN 3.5% 03/2015	250 000	101.26%	EUR	101.26%	4 914	258 057
BBVASM 4.375% 9/2015	1 000 000	99.92%	EUR	99.92%	1 199	1 000 390
BANEST 3.5% 01/2015	700 000	100.73%	EUR	100.73%	16 579	721 685
SANTAN 2.875% 01/18	500 000	99.34%	EUR	99.34%	9 610	506 286
BPIM 3.875% 03/2014	2 500 000	99.98%	EUR	99.98%	48 836	2 548 376
ISPIM 4.125% 01/2016	300 000	102.46%	EUR	102.46%	8 815	316 196
ISPIM 4.125% 09/2016	500 000	99.70%	EUR	99.70%	678	499 171
MER.LYNCH 4.625% /13	705 000	100.01%	EUR	100.01%	32 517	737 570
GS 4% 02/2015	1 500 000	104.04%	EUR	104.04%	39 616	1 600 223
GE CAP 4.625% 07/14	500 000	101.05%	EUR	101.05%	5 639	510 877
GE 2.875% 06/2019	1 000 000	104.61%	EUR	104.61%	8 271	1 054 409
CXGD 5.125% 02/2014	300 000	100.58%	EUR	100.58%	9 436	311 170
BNP Float 12/2014	100 000	100.22%	EUR	100.22%	47	100 264
MS Float 04/2016	225 000	98.68%	EUR	98.68%	301	222 327
BAC Float 05/2016	100 000	99.13%	EUR	99.13%	51	99 182
TELEFO Float 06/2015	300 000	101.05%	EUR	101.05%	495	303 636
SOCGEN Float 01/2015	100 000	100.32%	EUR	100.32%	145	100 460
GE Float 02/2016	300 000	99.37%	EUR	99.37%	125	298 238
ENIIMFloat 10/2017	200 000	107.77%	EUR	107.77%	3 006	218 542
BAVB Float 10/14	35 000	99.05%	EUR	99.05%	37	34 704
UCGIM Float 02/2014	35 000	99.86%	EUR	99.86%	21	34 973
UCGIM Float 01/2016	200 000	99.75%	EUR	99.75%	678	200 174

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
INTNED Float 11/2014	350 000	100.34%	EUR	100.34%	236	351 437
BMW Float 09/2016	200 000	99.95%	EUR	99.95%	67	199 969
						15 796 286
						20 228 848

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC domiciliados em Portugal						1 545 260
UPs de OIC abertos						
CXGEST ACTIVOS CP	34 995	10.82	EUR	10.82		378 763
FEI CX F. MONETARIO	211 851	5.51	EUR	5.51		1 166 496
						1 545 260
						1 545 260

LIQUIDEZ

À vista					151	151
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.1032%			EUR		151	151
A prazo					481 969	40 296 969
Depósitos com pré aviso e a prazo						
DP DP CGD 21/04 393d 3.0000% 2013-04-22 a 2014-05-20			EUR		27 000	2 027 000
DP DP CGD 4/7 368d 2.7500% 2013-07-04 a 2014-07-07			EUR		13 597	2 013 597
DP DP CGD 27/06 363d 2.7500% 2013-06-27 a 2014-06-25			EUR		55 733	7 655 733
DP DP CGD 28/9 368d 2.9000% 2012-09-28 a 2013-10-01			EUR		44 467	1 544 467
DP DP CGD 21/12 364d 3.0500% 2012-12-21 a 2013-12-20			EUR		98 771	4 203 771
DP DP CGD 30/01 356d 2.9500% 2013-01-30 a 2014-01-21			EUR		11 997	611 997
DP DP CGD 30-10 395d 3.1500% 2012-10-30 a 2013-11-29			EUR		14 700	514 700
DP DP CGD 28/03 391d 3.0000% 2013-03-28 a 2014-04-23			EUR		77 917	5 077 917
DP DP CGD 31/12 354d 3.0500% 2012-12-31 a 2013-12-20			EUR		14 160	624 160
DP DP CGD 10/10 359d 3.0000% 2012-10-10 a 2013-10-04			EUR		77 133	2 677 133
DP DP CGD 29/07 365d 2.7500% 2013-07-29 a 2014-07-29			EUR		22 000	4 522 000
DP DP CGD 01/03 378d 3.0000% 2013-03-01 a 2014-03-14			EUR		10 700	610 700
DP DP CGD 9/11 364d 3.1500% 2012-11-09 a 2013-11-08			EUR		11 410	411 410
DP DP CGD 27/09 364d 2.7500% 2013-09-27 a 2014-09-26			EUR		2 383	7 802 383
						40 296 969
						40 297 120

OUTROS VALORES A REGULARIZAR

Valores Activos						573 900
Valores Passivos						-72 072
						501 828
						62 573 055

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

10 903 490.91

Valor da Unidade de Participação 5.7388 €