

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2º PISO, 1000, LISBOA
 FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
 Composição da Carteira em 2018-05-31

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.					11 008	3 266 422
Obrigações diversas						
CXGD 3% 01/2019	600 000	101.87%	EUR	101.87%	6 756	617 952
TAGST 09-ENGY A1/25	741 802	103.23%	EUR	103.23%	586	766 348
CXGD 1% 01/2022	700 000	102.14%	EUR	102.14%	2 397	717 398
VERSE 3 SNR 02/2019	806 782	100.55%	EUR	100.55%	847	812 051
VERSE 4 SNR 02/2021	343 938	102.42%	EUR	102.42%	422	352 672
						3 266 422
Merc Cot. Ofic. B.V. Estados Membros UE					1 026 389	141 586 576
Titulos de Dívida Pública						
FADE 0.031% 06/2020	5 400 000	99.64%	EUR	99.64%	1 605	5 381 949
Obrigações diversas						
NOSPL 1.125% 05/23	2 500 000	99.84%	EUR	99.84%	2 312	2 498 337
DAIGR Float 07/24	1 000 000	99.75%	EUR	99.75%	198	997 728
VW Float 07/19	1 100 000	100.13%	EUR	100.13%	38	1 101 435
BASGR Float 11/19	1 300 000	100.36%	EUR	100.36%		1 304 680
SAPGR Float 03/21	1 100 000	100.52%	EUR	100.52%		1 105 709
COFP 4.481% 11/2018	6 000 000	102.25%	EUR	102.25%	189 359	6 324 119
LGFP 5.375% 11/2018	5 000 000	102.61%	EUR	102.61%	135 479	5 265 729
COFP 5.244% 03/2020	1 000 000	106.91%	EUR	106.91%	12 068	1 081 148
PPFP 3.125% 04/2019	258 000	102.89%	EUR	102.89%	861	266 328
RENAUL 1.125% 09/19	1 200 000	101.40%	EUR	101.40%	9 025	1 225 861
MCFP 1% 09/2021	1 400 000	102.83%	EUR	102.83%	9 589	1 449 265
BPCEGP 5.1% 06/2018	1 480 000	100.35%	EUR	100.35%	13 537	1 498 784
RENAUL 3.625% 09/18	2 000 000	101.11%	EUR	101.11%	50 651	2 072 831
KERFP 1.875% 10/2018	1 500 000	100.69%	EUR	100.69%	18 185	1 528 595
BNFP Float 11/18	400 000	100.12%	EUR	100.12%		400 492
RENAULT Float 08/20	100 000	100.23%	EUR	100.23%	18	100 243
BPCEGP Float 03/22	500 000	101.22%	EUR	101.22%	844	506 944
RENAULT Float 04/21	100 000	100.58%	EUR	100.58%	45	100 622
ACAFP Float 04/22	1 000 000	100.16%	EUR	100.16%	551	1 002 161
MCFP 0% 05/20	4 300 000	100.10%	EUR	100.10%		4 304 429
MCFP Float 11/18	465 000	100.13%	EUR	100.13%		465 591
BNP Float 06/24	800 000	98.66%	EUR	98.66%	808	790 096
RENAUL Float 03/2022	400 000	100.31%	EUR	100.31%	301	401 549
GFCFP Float 06/22	800 000	99.82%	EUR	99.82%	73	798 657
ALDFP Float 11/20	500 000	100.03%	EUR	100.03%	6	500 151
SANFP Float 03/20	900 000	100.44%	EUR	100.44%		903 915
BNP Float 05/23	500 000	98.64%	EUR	98.64%	41	493 236
ABBEY 2.625% 07/2020	750 000	105.29%	EUR	105.29%	17 260	806 935
LLOYDS 1.875% 10/18	1 500 000	100.72%	EUR	100.72%	18 031	1 528 876
ABBEY 2% 01/2019	1 000 000	101.31%	EUR	101.31%	7 562	1 020 642
DGELN 1.125% 05/2019	1 000 000	101.05%	EUR	101.05%	370	1 010 860

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-05-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ABBEY 0.875% 01/2020	500 000	101.29%	EUR	101.29%	1 666	508 126
LLOYDS 0.625% 04/20	1 500 000	101.16%	EUR	101.16%	1 079	1 518 494
HSBC Float 09/22	750 000	100.39%	EUR	100.39%	510	753 413
F Float 08/20	300 000	100.26%	EUR	100.26%	4	300 796
WPPLN Float 05/20	800 000	100.07%	EUR	100.07%		800 592
SANUK Float 05/23	500 000	99.36%	EUR	99.36%	88	496 868
RBS Float 06/20	900 000	100.06%	EUR	100.06%	219	900 759
LLOYDS Float 06/2024	1 000 000	98.71%	EUR	98.71%	902	987 982
HSBC 0.17% 10/23	500 000	99.11%	EUR	99.11%	136	495 681
RBS Float 03/2020	100 000	100.05%	EUR	100.05%	18	100 071
GSK Float 05/20	500 000	100.39%	EUR	100.39%		501 970
TELEFO 4.693% 11/19	1 000 000	106.54%	EUR	106.54%	25 972	1 091 392
REDELE 4.875% 04/202	1 000 000	109.15%	EUR	109.15%	4 408	1 095 898
SANTAN 1.1% 07/2018	2 000 000	100.17%	EUR	100.17%	18 504	2 021 824
SANSCF Float 01/19	600 000	100.05%	EUR	100.05%	103	600 427
IBESM Float 02/24	1 100 000	100.75%	EUR	100.75%	116	1 108 355
SANTAN Float 03/22	600 000	100.64%	EUR	100.64%	829	604 645
BBVASM Float 04/22	1 200 000	99.74%	EUR	99.74%	452	1 197 296
CRUNAV Float 06/2022	500 000	99.52%	EUR	99.52%	321	497 911
VLVY 2.375% 11/26/19	250 000	103.55%	EUR	103.55%	3 042	261 907
SCANIA Float 10/18	500 000	100.09%	EUR	100.09%	12	500 457
SCANIA Float 04/20	500 000	100.21%	EUR	100.21%	42	501 102
ENIIM 4.25% 02/20	700 000	106.82%	EUR	106.82%	9 618	757 330
ISPIM 1.125% 01/2020	1 600 000	100.42%	EUR	100.42%	6 805	1 613 509
ISPIM 4.125% 04/2020	750 000	105.91%	EUR	105.91%	4 068	798 371
UCGIM 5.65% 08/2018	1 000 000	101.30%	EUR	101.30%	43 497	1 056 492
ISPIM 2% 06/2021	1 000 000	102.29%	EUR	102.29%	19 068	1 041 928
ISPIM Float 04/22	450 000	98.28%	EUR	98.28%	334	442 594
GS 5.125% 10/2019	1 200 000	107.09%	EUR	107.09%	37 237	1 322 365
BAC 2.5% 07/2020	750 000	105.09%	EUR	105.09%	15 873	804 018
JPM Float 06/2018	650 000	100.01%	EUR	100.01%		650 072
MS Float 01/22	500 000	100.23%	EUR	100.23%	181	501 341
MS Float 03/12/2019	200 000	100.13%	EUR	100.13%	85	200 353
BAC Float 02/22	200 000	100.57%	EUR	100.57%	66	201 206
BAC Float 05/23	400 000	100.04%	EUR	100.04%	140	400 316
GM Float 05/21	1 800 000	100.55%	EUR	100.55%	387	1 810 251
TMO Float 07/2019	1 500 000	100.13%	EUR	100.13%		1 501 905
BATSLN Float 08/21	500 000	100.01%	EUR	100.01%	39	500 074
BAC Float 09/21	500 000	99.69%	EUR	99.69%	41	498 481
GS Float 09/23	1 100 000	98.84%	EUR	98.84%	596	1 087 836
UTX Float 11/19	1 500 000	100.20%	EUR	100.20%		1 502 940
T Float 09/2023	1 500 000	101.42%	EUR	101.42%	1 918	1 523 188
MS Float 05/21	500 000	99.79%	EUR	99.79%	11	498 966
CS 1.375% 11/2019	1 200 000	102.10%	EUR	102.10%	8 318	1 233 482
UBS Float 09/2019	400 000	100.38%	EUR	100.38%	169	401 693
UBS Float 04/2021	200 000	100.36%	EUR	100.36%	37	200 751
REPSM 4.875% 02/2019	2 500 000	103.50%	EUR	103.50%	34 058	2 621 633

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-05-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
IBESM 4.25% 10/2018	1 200 000	101.56%	EUR	101.56%	32 556	1 251 228
ENELIM 4.875% 03/20	1 250 000	108.40%	EUR	108.40%	13 690	1 368 640
REPSM 2.625% 05/2020	2 500 000	104.84%	EUR	104.84%	719	2 621 744
IBESM 2.875% 11/2020	1 000 000	106.65%	EUR	106.65%	15 911	1 082 391
RENEPL 4.75% 10/2020	1 000 000	110.76%	EUR	110.76%	29 671	1 137 291
ACHMEA 2.5% 11/2020	2 800 000	105.72%	EUR	105.72%	37 205	2 997 281
NOMURA 1.125% 06/20	1 000 000	101.92%	EUR	101.92%	11 188	1 030 418
ACHMEA 0.875% 09/18	4 000 000	100.30%	EUR	100.30%	24 644	4 036 724
ABNANV Float 01/19	600 000	100.26%	EUR	100.26%	131	601 679
MYL FLOAT 11/18	1 200 000	100.26%	EUR	100.26%	181	1 203 289
VW 0.5% 03/21	600 000	100.57%	EUR	100.57%	518	603 932
VW Float 03/19	600 000	100.11%	EUR	100.11%	22	600 670
BMW 0.125% 07/20	3 000 000	100.27%	EUR	100.27%	3 421	3 011 431
LPTY Float 11/20	800 000	100.29%	EUR	100.29%	119	802 471
MYL Float 05/20	800 000	100.10%	EUR	100.10%	31	800 839
PHIANA Float 09/2019	750 000	100.27%	EUR	100.27%		751 988
AKZANA Float 11/19	900 000	100.24%	EUR	100.24%		902 160
ANNGR FLOAT 11/19	500 000	100.22%	EUR	100.22%	4	501 109
ALVGR Float 12/20	300 000	100.95%	EUR	100.95%	124	302 965
LPTY Float 01/21	200 000	100.25%	EUR	100.25%	35	200 539
ADNA Float 03/21	200 000	100.15%	EUR	100.15%		200 308
DAIGR Float 04/20	300 000	100.56%	EUR	100.56%	74	301 748
TOYOTA FLT 04/27	500 000	100.45%	EUR	100.45%	11	502 247
NYKRE Float 06/22	1 000 000	100.17%	EUR	100.17%	614	1 002 294
JYBC Float 06/20	1 000 000	100.24%	EUR	100.24%	58	1 002 408
CBSBKF Float 03/21	600 000	100.28%	EUR	100.28%	245	601 943
KBCBB Float 11/22	500 000	99.76%	EUR	99.76%	25	498 815
GE 2.875% 06/2019	1 000 000	103.06%	EUR	103.06%	27 411	1 058 041
GE 2.25% 07/2020	2 000 000	104.67%	EUR	104.67%	38 959	2 132 339
DLTAS 2008-1 A	1 009 685	99.73%	EUR	99.73%	50	1 007 050
DHR Float 06/22	700 000	100.18%	EUR	100.18%		701 246
DE Float 09/20	1 000 000	100.31%	EUR	100.31%		1 003 110
SUMIBK Float 06/22	500 000	99.58%	EUR	99.58%	135	498 030
BMO Float 09/21	750 000	100.52%	EUR	100.52%	232	754 147
BNS FLOAT 10/22	1 000 000	100.95%	EUR	100.95%	431	1 009 971
ICBCAS FLOAT 10/20	1 000 000	100.07%	EUR	100.07%	307	1 001 047
BCHINA Float 11/20	300 000	99.96%	EUR	99.96%	12	299 877
AMXLMM 4.125%10/2019	700 000	105.73%	EUR	105.73%	17 325	757 435
AMXLMM 1% 06/2018	2 500 000	99.99%	EUR	99.99%	24 795	2 524 595
PEMEX Float 08/23	200 000	100.35%	EUR	100.35%	92	200 790
PEMEX 2.5% 11/22	250 000	99.89%	EUR	99.89%	137	249 857
GLENLN 2.625% 11/18	800 000	101.17%	EUR	101.17%	11 162	820 514
BACR Float 03/2021	900 000	96.59%	EUR	96.59%	250	869 587
GSFloat 10/2019	50 000	100.66%	EUR	100.66%	19	50 346
GS Float 09/2018	500 000	100.14%	EUR	100.14%	363	501 053
BAC Float 05/2019	700 000	100.95%	EUR	100.95%	572	707 222
C Float 11/2019	100 000	100.53%	EUR	100.53%	13	100 541

CGD PENSÕES - SGFP,SA

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

FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE

Composição da Carteira em 2018-05-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ANNGR Float 09/18	500 000	100.06%	EUR	100.06%	59	500 334
UNANA Float 06/18	500 000	100.00%	EUR	100.00%		500 006
BSN Float 09/2018	500 000	100.10%	EUR	100.10%	60	500 535
RY Float 03/2019	300 000	100.32%	EUR	100.32%	67	301 033
RY Float 10/2018	500 000	100.16%	EUR	100.16%	55	500 860
DAIGR Float 01/2019	200 000	100.26%	EUR	100.26%	56	200 576
VOD Float 02/2019	200 000	100.62%	EUR	100.62%	24	201 256
RENAUL Float 03/19	600 000	100.65%	EUR	100.65%	829	604 705
NDASS Float 02/19	200 000	100.28%	EUR	100.28%	7	200 573
UCGIM Float 02/2020	650 000	99.83%	EUR	99.83%	134	649 016
FDX Float 04/19	300 000	100.34%	EUR	100.34%	94	301 123
CAPFP Float 07/2018	700 000	100.05%	EUR	100.05%	598	700 927
VW Float 07/2018	100 000	100.02%	EUR	100.02%		100 021
ISPIM Float 04/2019	600 000	100.18%	EUR	100.18%	541	601 639
ISPIM Float 06/20	200 000	99.55%	EUR	99.55%	313	199 409
NWIDE Float 11/2018	700 000	100.18%	EUR	100.18%	100	701 388
SWEDA FLOAT 08/2020	200 000	100.80%	EUR	100.80%	14	201 620
SWEDA FLOAT 03/19	200 000	100.53%	EUR	100.53%	190	201 250
						136 204 626
Merc.Cot.Ofic. de B.V. de Estados não EU					29 493	7 402 248
Obrigações diversas						
HUWY 1.375% 10/2021	2 000 000	103.58%	EUR	103.58%	16 048	2 087 648
K 1.75% 05/2021	1 000 000	104.25%	EUR	104.25%	384	1 042 834
KO Float 03/19	300 000	100.20%	EUR	100.20%		300 606
F Float 05/21	300 000	99.77%	EUR	99.77%	15	299 337
UBS Float 09/22	1 000 000	100.09%	EUR	100.09%	754	1 001 644
AGN Float 06/19	1 000 000	100.09%	EUR	100.09%	56	1 000 936
WESAU 1.25% 10/2021	1 500 000	103.77%	EUR	103.77%	12 175	1 568 725
AT&T Float 06/19	100 000	100.46%	EUR	100.46%	62	100 519
						7 402 248
						152 255 245
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC domiciliados em Portugal						36 809 423
CXG OBRIGAÇÕES	2 258 307	4.45	EUR	4.45		10 060 530
CXG LIQUIDEZ	5 021 569	5.33	EUR	5.33		26 748 894
OIC domiciliados num Estado-membro da EU						24 864 905
AXA WF EUR SD-I-XC€	248 649	100.00	EUR	100.00		24 864 905
						61 674 328
LIQUIDEZ						
À vista						26 861 964
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			26 861 964
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
Valores Passivos						-120 869

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV.JOÃO XXI, 63 2ºPISO, 1000, LISBOA
FUNDO DE PENSÕES ABERTO: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2018-05-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
						-120 869
						240 670 669

VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO

NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO

40 895 921.76

Valor da Unidade de Participação: € 5.8850