

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-04-30

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.					3 255	1 673 169
Obrigações diversas						
TAGST 09-ENGY A1/25	539 239	102.03%	EUR	102.03%	400	550 601
CXGD 1% 01/2022	1 100 000	101.79%	EUR	101.79%	2 855	1 122 567
						1 673 169
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					398 822	147 188 699
Títulos de Dívida Pública						
CCTS Float 06/2022	5 000 000	99.04%	EUR	99.04%	4 025	4 956 125
Obrigações diversas						
NOSPL 1.125% 05/23	2 500 000	99.82%	EUR	99.82%	28 048	2 523 423
SAPGR Float 03/21	1 100 000	99.63%	EUR	99.63%		1 095 930
VW 1.375% 10/2023	500 000	100.24%	EUR	100.24%	3 719	504 914
SAPGR 0.25% 03/2022	500 000	100.33%	EUR	100.33%	178	501 833
VW 1.25% 08/2022	900 000	99.60%	EUR	99.60%	8 422	904 822
VW Float 02/2021	300 000	99.44%	EUR	99.44%	240	298 572
DB Float 12/2020	2 000 000	98.71%	EUR	98.71%	91	1 974 251
VW 0.5% 06/2022	350 000	97.92%	EUR	97.92%	1 516	344 222
MRKGR 0.005% 12/2023	400 000	99.53%	EUR	99.53%	8	398 144
EOANGR 0% 09/2022	1 500 000	99.34%	EUR	99.34%		1 490 040
EOANGR 0% 12/2023	650 000	99.09%	EUR	99.09%		644 053
PBBGR Float 07/28/23	2 300 000	98.11%	EUR	98.11%	136	2 256 620
PBBGR 0.625% 02/2022	700 000	98.90%	EUR	98.90%	813	693 127
MCFP 1% 09/2021	1 400 000	100.85%	EUR	100.85%	8 415	1 420 315
BFCM Float 06/2020	700 000	99.99%	EUR	99.99%	53	699 962
RENAULT Float 08/20	100 000	99.81%	EUR	99.81%	8	99 819
BNP Float 09/22	1 500 000	99.18%	EUR	99.18%	743	1 488 413
BPCEGP Float 03/22	500 000	99.59%	EUR	99.59%	428	498 388
RENAULT Float 04/21	100 000	98.31%	EUR	98.31%	19	98 328
ACAFP Float 04/22	1 000 000	99.18%	EUR	99.18%	176	991 956
MCFP 0% 05/20	4 300 000	99.98%	EUR	99.98%		4 299 054
RENAUL Float 03/2022	400 000	96.26%	EUR	96.26%	93	385 137
GFCFP Float 06/22	800 000	98.69%	EUR	98.69%	22	789 510
RENAULT 0.75% 09/22	2 500 000	96.30%	EUR	96.30%	11 168	2 418 718
ALDFP Float 11/20	500 000	99.52%	EUR	99.52%	12	497 622
ACAFP Float 03/23	500 000	98.06%	EUR	98.06%	103	490 398
HSBC 0.2% 09/21	2 000 000	99.73%	EUR	99.73%	2 623	1 997 123
ACAFP Float 01/2022	1 200 000	99.46%	EUR	99.46%	140	1 193 672
BFCM 0.125% 08/2021	1 500 000	99.54%	EUR	99.54%	1 255	1 494 295
MCFP 0% 02/2021	300 000	99.72%	EUR	99.72%		299 154
SOCGEN 0% 05/2022	500 000	99.05%	EUR	99.05%		495 230
VIVFP 0% 06/2022	1 400 000	98.56%	EUR	98.56%		1 379 854
BPCEGP Float 01/2023	500 000	97.33%	EUR	97.33%	58	486 693
CAFP Float 09/2023	400 000	97.36%	EUR	97.36%	93	389 541
DSYFP 0% 09/2022	700 000	98.94%	EUR	98.94%		692 608
RENAUL 0.25% 03/23	200 000	95.21%	EUR	95.21%	74	190 498
EFPF 0% 05/23	700 000	99.07%	EUR	99.07%		693 455
F 1.875% 06/2021	1 000 000	96.07%	EUR	96.07%	15 984	976 724
HSBC Float 09/22	250 000	98.82%	EUR	98.82%	80	247 133

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
F Float 08/20	300 000	97.82%	EUR	97.82%	47	293 495
WPPLN Float 05/20	800 000	99.97%	EUR	99.97%		799 784
RBS Float 06/20	900 000	99.96%	EUR	99.96%		899 631
CCE FLOAT 11/21	500 000	99.30%	EUR	99.30%		496 515
RBS Float 09/21	1 400 000	99.10%	EUR	99.10%	723	1 388 095
DGELN 0.25% 10/2021	1 550 000	99.31%	EUR	99.31%	2 033	1 541 322
RBS Float 06/2021	350 000	99.16%	EUR	99.16%	133	347 179
AALLN 2.875% 11/2020	175 000	100.76%	EUR	100.76%	2 241	178 567
GSK Float 09/2021	500 000	99.69%	EUR	99.69%	112	498 582
RBS Float 03/21	400 000	99.44%	EUR	99.44%	117	397 873
LLOYDS 0.375% 01/25	350 000	95.64%	EUR	95.64%	337	335 074
MRLSM 2.225% 04/23	2 000 000	100.15%	EUR	100.15%	732	2 003 652
SANSCF1% 05/21	1 400 000	100.13%	EUR	100.13%	13 044	1 414 794
SANTAN Float 03/22	600 000	98.81%	EUR	98.81%	408	593 286
CRUNAV Float 06/2022	500 000	98.60%	EUR	98.60%	139	493 137
CABKSM 1.125% 1/2023	2 700 000	98.82%	EUR	98.82%	9 129	2 677 377
AMSSM Float 03/22	600 000	97.43%	EUR	97.43%	29	584 591
KUTXAB 0.5% 09/2024	200 000	94.80%	EUR	94.80%	598	190 200
SWEDA 0.25% 11/22	3 000 000	99.34%	EUR	99.34%	3 607	2 983 777
VLVY 0.1% 05/2022	300 000	97.67%	EUR	97.67%	281	293 279
SWEDA 0.25% 10/2024	300 000	96.71%	EUR	96.71%	420	290 562
VLVY 0% 02/2023	400 000	96.98%	EUR	96.98%		387 924
ISPIM 2% 06/2021	1 000 000	100.82%	EUR	100.82%	17 377	1 025 547
ISPIM Float 04/22	2 350 000	97.92%	EUR	97.92%	521	2 301 618
FCABNK Float 06/21	2 500 000	97.70%	EUR	97.70%		2 442 500
FCABNK 0.625% 11/22	150 000	96.11%	EUR	96.11%	407	144 574
AZMIM 1.625% 12/2024	1 000 000	91.61%	EUR	91.61%	6 260	922 350
FCABNK 0.25% 02/2023	400 000	94.39%	EUR	94.39%	255	377 799
C Float 05/21	3 000 000	99.92%	EUR	99.92%	2 345	2 999 915
MS Float 01/22	2 500 000	99.02%	EUR	99.02%	150	2 475 525
WFC Float 01/22	1 000 000	98.61%	EUR	98.61%	7	986 077
BAC Float 02/22	1 200 000	99.31%	EUR	99.31%	1 120	1 192 864
GS Float 09/22	1 500 000	98.00%	EUR	98.00%	356	1 470 386
BAC Float 05/23	1 000 000	98.52%	EUR	98.52%	935	986 145
GM Float 05/21	1 800 000	94.74%	EUR	94.74%	1 138	1 706 416
GE 0.375% 05/22	3 500 000	98.34%	EUR	98.34%	12 551	3 454 416
BAC Float 09/21	2 500 000	99.10%	EUR	99.10%		2 477 450
C Float 03/23	1 000 000	97.98%	EUR	97.98%	116	979 916
MS Float 05/21	500 000	99.55%	EUR	99.55%		497 755
T Float 09/23	500 000	98.20%	EUR	98.20%	335	491 345
EMR 0.375% 05/2024	400 000	99.17%	EUR	99.17%	1 414	398 094
HOG 0.9% 11/19/24	250 000	91.45%	EUR	91.45%	1 008	229 628
FIS 0.125% 12/2022	700 000	98.69%	EUR	98.69%	359	691 203
CB 0.3% 12/2024	800 000	97.40%	EUR	97.40%	964	780 164
GS Float 04/2023	1 000 000	97.08%	EUR	97.08%	85	970 905
F 1.744% 07/2024	800 000	83.86%	EUR	83.86%	2 714	673 570
HON 0% 03/2024	300 000	98.06%	EUR	98.06%		294 177
BRK 0% 03/2025	500 000	98.39%	EUR	98.39%		491 960
UBS Float 04/2021	900 000	99.76%	EUR	99.76%	53	897 884
SCANIA Float 03/21	1 100 000	99.38%	EUR	99.38%	30	1 093 243
REPSM 2.625% 05/2020	2 500 000	100.09%	EUR	100.09%	60 784	2 563 084
RENEPL 4.75% 10/2020	1 600 000	101.87%	EUR	101.87%	41 115	1 670 955

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
ACHMEA 2.5% 11/2020	2 800 000	101.01%	EUR	101.01%	31 366	2 859 562
NOMURA 1.125% 06/20	1 000 000	100.05%	EUR	100.05%	10 236	1 010 726
EDPPL 2.375% 03/23	2 000 000	105.17%	EUR	105.17%	5 075	2 108 555
BMW 0.125% 07/20	3 000 000	99.86%	EUR	99.86%	3 105	2 998 935
LPTY Float 11/20	800 000	99.30%	EUR	99.30%	246	794 678
MYL Float 05/20	800 000	99.92%	EUR	99.92%	134	799 478
NIBCAP 1.5% 01/22	1 000 000	100.38%	EUR	100.38%	3 730	1 007 550
LPTY Float 01/21	200 000	98.97%	EUR	98.97%	8	197 940
ADNA Float 03/21	200 000	99.67%	EUR	99.67%		199 330
BAYNGR Float 06/22	300 000	98.34%	EUR	98.34%	53	295 061
NIBCAP Float 07/20	900 000	99.65%	EUR	99.65%	7	896 839
TOYOTA 0.25% 01/2022	2 100 000	99.29%	EUR	99.29%	1 607	2 086 655
ANNGR Float 12/2022	2 000 000	97.65%	EUR	97.65%	124	1 953 144
NIBCAP 0.875% 07/25	400 000	96.07%	EUR	96.07%	2 850	387 118
ENELIM 0% 06/2024	700 000	97.37%	EUR	97.37%		681 604
ALVGR 0% 01/2025	1 300 000	99.93%	EUR	99.93%		1 299 116
DLR 0.125% 10/2022	300 000	97.45%	EUR	97.45%	108	292 452
DANBNK 0.5% 05/21	1 000 000	99.91%	EUR	99.91%	4 932	1 004 042
NYKRE Float 06/22	2 000 000	97.71%	EUR	97.71%	483	1 954 723
JYBC Float 06/20	1 000 000	99.95%	EUR	99.95%		999 460
DANBNK 1.375% 05/22	2 000 000	100.05%	EUR	100.05%	25 772	2 026 732
MINGNO 0.75% 03/23	1 500 000	100.47%	EUR	100.47%	9 314	1 516 304
SPOLNO Float 09/21	1 900 000	98.93%	EUR	98.93%	279	1 879 911
SCBNOR 0.875% 01/22	200 000	100.18%	EUR	100.18%	483	200 841
CBSBKF Float 03/21	600 000	99.53%	EUR	99.53%	27	597 219
KBCBB 0.75% 10/23	1 500 000	100.09%	EUR	100.09%	6 025	1 507 315
KBCBB Float 11/22	500 000	97.50%	EUR	97.50%	130	487 650
KBCBB 1.125% 01/2024	400 000	101.53%	EUR	101.53%	1 193	407 297
RBIAS 0.25% 01/2025	1 300 000	97.29%	EUR	97.29%	888	1 265 645
DLTAS 2008-1 A	634 097	98.50%	EUR	98.50%	19	624 604
GLENLN 1.625% 01/22	1 500 000	98.75%	EUR	98.75%	6 926	1 488 176
DHR Float 06/22	1 000 000	98.02%	EUR	98.02%		980 180
DE Float 09/20	1 000 000	99.91%	EUR	99.91%		999 090
BDX 0.174% 06/2021	1 000 000	98.73%	EUR	98.73%	1 578	988 868
SUMIBK Float 06/22	1 500 000	97.30%	EUR	97.30%		1 459 500
MUFG 0.98% 10/2023	1 000 000	99.75%	EUR	99.75%	5 489	1 003 009
MUFG 0.339% 07/2024	200 000	96.63%	EUR	96.63%	532	193 796
BNS FLOAT 10/22	1 000 000	98.68%	EUR	98.68%	183	987 023
BCHINA Float 11/20	300 000	99.71%	EUR	99.71%	34	299 161
ISLBAN 1.125% 04/22	600 000	99.06%	EUR	99.06%	351	594 693
BACR Float 03/2021	900 000	98.13%	EUR	98.13%	75	883 200
WFC Float 04/21	1 000 000	99.63%	EUR	99.63%	51	996 391
NDASS Float 06/2020	1 000 000	99.99%	EUR	99.99%		999 860
DNBNO Float 08/20	700 000	99.90%	EUR	99.90%		699 328
ISPIM Float 06/20	200 000	99.98%	EUR	99.98%	143	200 109
						142 232 574
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					49 012	13 535 104
Obrigações diversas						
HUWY 1.375% 10/2021	2 000 000	101.16%	EUR	101.16%	13 750	2 036 890
K 1.75% 05/2021	1 000 000	100.75%	EUR	100.75%	16 400	1 023 890
AMGN 1.25% 02/22	900 000	100.99%	EUR	100.99%	2 029	910 948

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
F Float 12/21	819 000	90.41%	EUR	90.41%		740 466
F Float 05/21	300 000	93.09%	EUR	93.09%	11	279 266
FDX 0.7% 05/2022	500 000	98.90%	EUR	98.90%	3 385	497 895
T Float 08/2020	400 000	99.91%	EUR	99.91%	2	399 658
KO Float 03/2021	400 000	99.79%	EUR	99.79%		399 140
UBS Float 09/22	1 000 000	98.32%	EUR	98.32%	341	983 511
ABT 0% 09/2020	700 000	99.77%	EUR	99.77%		698 411
MDT Cupao Zero 03/21	1 400 000	99.67%	EUR	99.67%		1 395 352
MDT Float 03/2021	1 150 000	99.48%	EUR	99.48%		1 144 043
TACHEM 0.375% 11/20	1 500 000	99.77%	EUR	99.77%	2 490	1 499 100
WESAU 1.25% 10/2021	1 500 000	101.06%	EUR	101.06%	10 605	1 526 535
						13 535 104
						162 396 971
OUTROS VALORES						
VAL. MOBILIÁRIOS NACIONAIS NÃO COTADOS					136	106 543
Obrigações diversas						
VERSE 4 SNR 02/2021	106 652	99.77%	EUR	99.77%	136	106 543
OUTROS INSTRUMENTOS DE DÍVIDA					19 809	10 707 016
Papel Comercial						
PC ECP CIE 07FEV 90D 0.0600% 2020-02-07 a 2020-05-07			EUR		142	1 011 990
PC ECP JMS 13/03 215D 0.9500% 2020-03-13 a 2020-10-14			EUR		761	597 422
PC ECP 23DEZEMBRO-SABA 0.3300% 2019-12-23 a 2020-09-08			EUR		1 545	1 298 455
PC ECP JMS 13/03 125D 0.6500% 2020-03-13 a 2020-07-16			EUR		522	599 190
PC P.C.VISABEIRA 18ªEM 2.6000% 2020-01-02 a 2020-06-30			EUR		8 233	958 233
PC P.C.VISABEIRA 26ªEM 3.0000% 2020-04-06 a 2020-06-05			EUR		1 771	851 771
PC ECP ECI 03/03 69D 0.0350% 2020-03-03 a 2020-05-11			EUR		79	1 399 987
PC ECP CIE 25FEV 90D 0.0600% 2020-02-25 a 2020-05-25			EUR		59	536 979
PC ECP JMS 15/01 273D 1.2500% 2020-01-15 a 2020-10-14			EUR		1 452	397 747
PC P.C.GLINTT 5ª EM. 2.5000% 2020-02-12 a 2020-05-12			EUR		3 566	653 566
PC P.C.C.AMORIM 44ª EM. 0.5000% 2020-04-09 a 2020-05-11			EUR		428	1 400 428
PC P.C.GLINTT 8ª EM. 3.0000% 2020-04-16 a 2020-06-15			EUR		1 250	1 001 250
						10 707 016
						10 813 559
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						9 170 052
Fundimo	1 174 729	7.81	EUR	7.81		9 170 052
LIQUIDEZ						
À VISTA						14 050 111
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			13 736 057
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			225 280
DO SANTANDER - 0.0000%			EUR			57 856
DO BCP - EUR 0.0000%			EUR			30 917
						14 050 111
A PRAZO					6 688	12 706 688
Depósitos com pré aviso e a prazo						
DP DP BIG 07/02 90D 0.1000% 2020-02-07 a 2020-05-07			EUR		233	1 000 233
DP DP SANTAN 05/06 365D 0.0600% 2019-06-05 a 2020-06-04			EUR		6 455	11 706 455

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-04-30

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
						12 706 688
						26 756 799
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
VALORES ACTIVOS						120 154
VALORES PASSIVOS						-140 018
						-19 865
						209 117 516
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
OEMO EUR EUX 06/20	-92	135.97	EUR	135.97		-12 509 240
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					35 971 015.11	
Valor da Unidade de Participação:	€ 5.8135					