

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-07-31

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.					6 013	1 628 215
Obrigações diversas						
TAGST 09-ENGY A1/25	512 248	98.38%	EUR	98.38%	393	504 357
CXGD 1% 01/2022	1 100 000	101.66%	EUR	101.66%	5 620	1 123 858
						1 628 215
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					359 680	146 872 686
Títulos de Dívida Pública						
CCTS Float 06/2022	5 000 000	100.36%	EUR	100.36%	2 396	5 020 496
Obrigações diversas						
NOSPL 1.125% 05/23	2 500 000	101.08%	EUR	101.08%	7 012	2 533 962
SAPGR Float 03/21	2 100 000	99.96%	EUR	99.96%		2 099 202
VW 1.375% 10/2023	500 000	102.31%	EUR	102.31%	5 447	516 987
SAPGR 0.25% 03/2022	500 000	100.63%	EUR	100.63%	493	503 648
VW 1.25% 08/2022	900 000	101.70%	EUR	101.70%	11 250	926 532
VW Float 02/2021	300 000	100.04%	EUR	100.04%	356	300 476
DB Float 12/2020	2 000 000	99.93%	EUR	99.93%	444	1 999 124
VW 0.5% 06/2022	350 000	100.20%	EUR	100.20%	201	350 912
MRKGR 0.005% 12/2023	400 000	100.00%	EUR	100.00%	13	400 025
EOANGR 0% 09/2022	1 500 000	100.17%	EUR	100.17%		1 502 580
EOANGR 0% 12/2023	650 000	99.94%	EUR	99.94%		649 623
PBBGR Float 07/28/23	2 300 000	99.75%	EUR	99.75%	116	2 294 274
PBBGR 0.625% 02/2022	700 000	99.46%	EUR	99.46%	1 913	698 105
BASGR 0.101% 06/2023	400 000	100.43%	EUR	100.43%	63	401 775
IFXGR 0.75% 06/2023	500 000	101.66%	EUR	101.66%	390	508 685
MCFP 1% 09/2021	1 400 000	101.06%	EUR	101.06%	11 934	1 426 816
BNP Float 09/22	1 500 000	100.81%	EUR	100.81%	768	1 512 888
BPCEGP Float 03/22	500 000	100.95%	EUR	100.95%	513	505 243
RENAULT Float 04/21	100 000	99.34%	EUR	99.34%	11	99 348
ACAFP Float 04/22	1 000 000	100.67%	EUR	100.67%	117	1 006 837
RENAUL Float 03/2022	400 000	98.22%	EUR	98.22%	163	393 027
GFCFP Float 06/22	1 000 000	99.35%	EUR	99.35%		993 510
RENAULT 0.75% 09/22	2 500 000	98.97%	EUR	98.97%	15 881	2 490 131
ALDFP Float 11/20	500 000	99.82%	EUR	99.82%	142	499 247
ACAFP Float 03/23	500 000	100.02%	EUR	100.02%	186	500 261
CAFP Float 06/22	2 000 000	99.96%	EUR	99.96%	684	1 999 784
HSBC 0.2% 09/21	2 000 000	100.36%	EUR	100.36%	3 628	2 010 888
ACAFP Float 01/2022	1 200 000	100.49%	EUR	100.49%	54	1 205 934
BFCM 0.125% 08/2021	1 500 000	100.41%	EUR	100.41%	1 726	1 507 801
MCFP 0% 02/2021	300 000	100.03%	EUR	100.03%		300 090
SOCGEN 0% 05/2022	500 000	99.99%	EUR	99.99%		499 935
VIVFP 0% 06/2022	1 400 000	99.94%	EUR	99.94%		1 399 202
BPCEGP Float 01/2023	500 000	99.50%	EUR	99.50%	16	497 496
CAFP Float 09/2023	400 000	99.70%	EUR	99.70%	159	398 939
DSYFP 0% 09/2022	700 000	100.04%	EUR	100.04%		700 308
RENAUL 0.25% 03/23	200 000	97.62%	EUR	97.62%	200	195 438
EFFP 0% 05/23	700 000	100.18%	EUR	100.18%		701 232
CAPFP 0.625% 06/2025	2 000 000	101.45%	EUR	101.45%	1 336	2 030 236
F 1.875% 06/2021	1 000 000	98.67%	EUR	98.67%	1 952	988 602

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
AMSSM 0.125% 10/20	1 000 000	99.80%	EUR	99.80%	1 025	999 045
HSBC Float 09/22	750 000	100.14%	EUR	100.14%	217	751 260
F Float 08/20	300 000	99.61%	EUR	99.61%	123	298 950
CCE FLOAT 11/21	500 000	99.95%	EUR	99.95%		499 750
RBS Float 09/21	1 400 000	100.61%	EUR	100.61%	639	1 409 123
DGELN 0.25% 10/2021	1 550 000	100.33%	EUR	100.33%	3 007	1 558 060
RBS Float 06/2021	350 000	100.35%	EUR	100.35%	149	351 363
AALLN 2.875% 11/2020	175 000	100.67%	EUR	100.67%	3 505	179 683
GSK Float 09/2021	500 000	100.27%	EUR	100.27%	105	501 450
RBS Float 03/21	400 000	100.19%	EUR	100.19%	210	400 970
LLOYDS 0.375% 01/25	350 000	100.06%	EUR	100.06%	667	350 860
GSK 0.125% 05/2023	200 000	100.65%	EUR	100.65%	55	201 359
MRLSM 2.225% 04/23	2 000 000	102.02%	EUR	102.02%	11 948	2 052 368
SANSCF1% 05/21	1 400 000	100.90%	EUR	100.90%	2 570	1 415 170
SANTAN Float 03/22	800 000	100.20%	EUR	100.20%	561	802 169
CRUNAV Float 06/2022	500 000	99.28%	EUR	99.28%	145	496 558
CABKSM 1.125% 1/2023	2 700 000	101.45%	EUR	101.45%	16 764	2 755 968
AMSSM Float 03/22	600 000	98.05%	EUR	98.05%	57	588 333
KUTXAB 0.5% 09/2024	200 000	97.25%	EUR	97.25%	850	195 354
SABSM 1.75% 06/2023	200 000	101.77%	EUR	101.77%	316	203 858
SWEDA 0.25% 11/22	3 000 000	100.59%	EUR	100.59%	5 492	3 023 102
VLVY 0.1% 05/2022	300 000	99.42%	EUR	99.42%	57	298 329
SWEDA 0.25% 10/2024	300 000	99.72%	EUR	99.72%	609	299 760
VLVY 0% 02/2023	400 000	98.86%	EUR	98.86%		395 444
ISPIM 2% 06/2021	1 000 000	101.62%	EUR	101.62%	2 411	1 018 601
ISPIM Float 04/22	2 350 000	99.95%	EUR	99.95%	392	2 349 123
FCABNK Float 06/21	2 500 000	98.83%	EUR	98.83%		2 470 650
FCABNK 0.625% 11/22	150 000	99.83%	EUR	99.83%	643	150 388
AZMIM 1.625% 12/2024	1 000 000	97.23%	EUR	97.23%	10 345	982 675
FCABNK 0.25% 02/2023	400 000	98.32%	EUR	98.32%	507	393 791
PG 2% 11/21	1 000 000	102.77%	EUR	102.77%	14 754	1 042 444
C Float 05/21	3 000 000	100.54%	EUR	100.54%	3 076	3 019 126
MS Float 01/22	2 500 000	100.14%	EUR	100.14%	86	2 503 686
WFC Float 01/22	1 000 000	100.16%	EUR	100.16%	1	1 001 561
BAC Float 02/22	1 200 000	100.22%	EUR	100.22%	1 442	1 204 070
GS Float 09/22	1 500 000	99.96%	EUR	99.96%	612	1 499 997
BAC Float 05/23	1 000 000	100.31%	EUR	100.31%	1 283	1 004 343
GM Float 05/21	1 800 000	98.91%	EUR	98.91%	1 730	1 782 104
GE 0.375% 05/22	3 500 000	99.48%	EUR	99.48%	2 733	3 484 428
BAC Float 09/21	2 500 000	100.04%	EUR	100.04%		2 500 875
C Float 03/23	1 000 000	99.84%	EUR	99.84%	123	998 523
MS Float 05/21	500 000	100.23%	EUR	100.23%	141	501 291
T Float 09/23	500 000	99.73%	EUR	99.73%	419	499 064
EMR 0.375% 05/2024	400 000	101.18%	EUR	101.18%	292	405 016
HOG 0.9% 11/19/24	250 000	96.15%	EUR	96.15%	1 574	241 954
FIS 0.125% 12/2022	700 000	100.32%	EUR	100.32%	579	702 798
FIS Float 05/2021	1 500 000	99.72%	EUR	99.72%	423	1 496 238
CB 0.3% 12/2024	800 000	99.79%	EUR	99.79%	1 567	799 911
GS Float 04/2023	1 000 000	99.29%	EUR	99.29%	33	992 963
F 1.744% 07/2024	800 000	94.27%	EUR	94.27%	497	754 673
HON 0% 03/2024	300 000	99.43%	EUR	99.43%		298 275
BRK 0% 03/2025	500 000	99.63%	EUR	99.63%		498 150

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
UBS Float 04/2021	900 000	100.25%	EUR	100.25%	11	902 252
SCANIA Float 03/21	1 100 000	99.73%	EUR	99.73%	131	1 097 172
RENEPL 4.75% 10/2020	1 600 000	100.82%	EUR	100.82%	60 219	1 673 307
ACHMEA 2.5% 11/2020	2 800 000	100.69%	EUR	100.69%	48 962	2 868 394
MYL 1.25% 11/20	400 000	100.13%	EUR	100.13%	3 443	403 947
EDPPL 2.375% 03/23	2 000 000	106.07%	EUR	106.07%	17 048	2 138 428
LPTY Float 11/20	800 000	99.92%	EUR	99.92%	512	799 872
DAIGR Float 05/22	1 500 000	99.54%	EUR	99.54%	144	1 493 184
NIBCAP 1.5% 01/22	1 000 000	101.04%	EUR	101.04%	7 500	1 017 930
LPTY Float 01/21	200 000	99.64%	EUR	99.64%	1	199 283
ADNA Float 03/21	200 000	99.84%	EUR	99.84%		199 678
BAYNGR Float 06/22	300 000	99.74%	EUR	99.74%	46	299 251
TOYOTA 0.25% 01/2022	2 100 000	100.53%	EUR	100.53%	2 926	2 114 014
BMW 0.625% 10/2023	1 000 000	102.06%	EUR	102.06%	5 123	1 025 673
ANNGR Float 12/2022	2 000 000	99.40%	EUR	99.40%	136	1 988 056
NIBCAP 0.875% 07/25	400 000	98.29%	EUR	98.29%	230	393 394
ENELIM 0% 06/2024	700 000	99.63%	EUR	99.63%		697 389
ALVGR 0% 01/2025	1 300 000	100.51%	EUR	100.51%		1 306 669
DLR 0.125% 10/2022	300 000	99.63%	EUR	99.63%	202	299 086
DANBNK 0.5% 05/21	1 000 000	100.54%	EUR	100.54%	1 192	1 006 542
NYKRE Float 06/22	2 000 000	99.67%	EUR	99.67%	877	1 994 357
DANBNK 1,375% 05/23	2 000 000	100.83%	EUR	100.83%	3 129	2 019 669
MINGNO 0.75% 03/23	1 500 000	101.35%	EUR	101.35%	894	1 521 099
SPOLNO Float 09/21	1 900 000	100.26%	EUR	100.26%	206	1 905 203
SCBNOR 0.875% 01/22	200 000	100.77%	EUR	100.77%	923	202 463
CBSBKF Float 03/21	600 000	99.93%	EUR	99.93%	133	599 731
KBCBB 0.75% 10/23	1 500 000	102.10%	EUR	102.10%	8 852	1 540 412
KBCBB Float 11/22	500 000	99.95%	EUR	99.95%	253	500 018
KBCBB 1.125% 01/2024	400 000	103.42%	EUR	103.42%	2 324	415 984
RBIAS 0.25% 01/2025	1 300 000	99.68%	EUR	99.68%	1 705	1 297 493
DLTAS 2008-1 A	584 871	99.64%	EUR	99.64%	8	582 773
GLENLN 1.625% 01/22	1 500 000	100.87%	EUR	100.87%	13 053	1 526 088
GLENLN 1.25% 03/2021	500 000	100.14%	EUR	100.14%	2 346	503 026
DHR Float 06/22	1 000 000	99.54%	EUR	99.54%		995 440
DE Float 09/20	1 000 000	100.01%	EUR	100.01%		1 000 080
BDX 0.174% 06/2021	1 000 000	99.81%	EUR	99.81%	276	998 336
SUMIBK Float 06/22	1 500 000	99.86%	EUR	99.86%	180	1 498 080
MUFG 0.98% 10/2023	1 000 000	102.67%	EUR	102.67%	7 952	1 034 632
MUFG 0.339% 07/2024	200 000	100.25%	EUR	100.25%	24	200 532
BNS FLOAT 10/22	1 000 000	100.49%	EUR	100.49%	124	1 005 034
BCHINA Float 11/20	300 000	99.97%	EUR	99.97%	112	300 019
ISLBAN 1.125% 04/22	600 000	100.44%	EUR	100.44%	2 053	604 687
ETISLT 1.75% 06/2021	900 000	101.36%	EUR	101.36%	1 899	914 130
BACR Float 03/2021	900 000	99.13%	EUR	99.13%	81	892 238
WFC Float 04/21	1 000 000	100.28%	EUR	100.28%	23	1 002 813
DNBNO Float 08/20	700 000	100.01%	EUR	100.01%	130	700 228
						141 852 190
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					50 888	17 454 245
Obrigações diversas						
HUWY 1.375% 10/2021	2 000 000	101.31%	EUR	101.31%	20 663	2 046 823
K 1.75% 05/2021	1 000 000	101.32%	EUR	101.32%	3 308	1 016 528

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
AMGN 1.25% 02/22	900 000	101.66%	EUR	101.66%	4 857	919 815
F Float 12/21	819 000	94.77%	EUR	94.77%	111	776 236
F Float 05/21	300 000	96.97%	EUR	96.97%	122	291 017
FDX 0.7% 05/2022	500 000	100.92%	EUR	100.92%	767	505 382
T Float 08/2020	1 900 000	100.00%	EUR	100.00%	653	1 900 681
KO Float 03/2021	400 000	100.07%	EUR	100.07%		400 264
UBS Float 09/22	1 000 000	100.21%	EUR	100.21%	346	1 002 426
ABT 0% 09/2020	1 500 000	99.99%	EUR	99.99%		1 499 820
MDT Cupao Zero 03/21	1 400 000	100.04%	EUR	100.04%		1 400 546
MDT Float 03/2021	2 150 000	99.94%	EUR	99.94%		2 148 710
TACHEM Float 11/22	500 000	100.85%	EUR	100.85%	841	505 101
TACHEM 0.375% 11/20	1 500 000	100.08%	EUR	100.08%	3 904	1 505 089
WESAU 1.25% 10/2021	1 500 000	101.37%	EUR	101.37%	15 318	1 535 808
						17 454 245
						165 955 146

OUTROS VALORES

VAL. MOBILIÁRIOS NACIONAIS NÃO COTADOS 96 75 318

Obrigações diversas

VERSE 4 SNR 02/2021 74 882 100.45% EUR 100.45% 96 75 318

OUTROS INSTRUMENTOS DE DÍVIDA

21 445 12 208 370

Papel Comercial

PC ECP CIE 10JULHO 25D 0.3000% 2020-07-10 a 2020-08-04			EUR		73	399 990
PC ECP JMS 13/03 215D 0.9500% 2020-03-13 a 2020-10-14			EUR		2 190	598 851
PC ECP 23DEZEMBRO-SABA 0.3300% 2019-12-23 a 2020-09-08			EUR		2 639	1 299 548
PC P.C.VISABEIRA 29ªEM 3.0000% 2020-06-05 a 2020-08-04			EUR		4 038	854 038
PC ECP JMS 16/07 123D 1.1000% 2020-07-16 a 2020-11-16			EUR		192	398 715
PC PC Unilever 75ª 0.0800% 2020-07-27 a 2020-08-27			EUR		19	1 700 019
PC P.C.GLINTT 12ª EM. 3.0000% 2020-06-15 a 2020-08-14			EUR		3 917	1 003 917
PC ECP CIE 16JULHO 62D 0.3500% 2020-07-16 a 2020-09-16			EUR		187	1 199 464
PC ECP JMS 16/07 60D 0.8000% 2020-07-16 a 2020-09-14			EUR		175	499 518
PC P.C.VISABEIRA 30ªEM 3.0000% 2020-06-30 a 2020-09-30			EUR		2 800	1 052 800
PC P.C.GLINTT 14ª EM. 3.0000% 2020-07-10 a 2020-10-08			EUR		1 283	701 283
PC ECP JMS 15/01 273D 1.2500% 2020-01-15 a 2020-10-14			EUR		2 701	398 996
PC P.C.SONAE 983ª EM. 0.3300% 2020-05-29 a 2020-08-31			EUR		1 232	2 101 232
						12 208 370
						12 283 688

UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)

OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL

Fundimo 1 189 915 7.80 EUR 7.80 9 283 836

LIQUIDEZ

À VISTA 19 601 246

Depósitos à ordem

DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			7 596 390
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			208 976
DO SANTANDER - 0.0000%			EUR			11 764 963
DO BCP - EUR 0.0000%			EUR			30 917
						19 601 246

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-07-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
A PRAZO					24	1 000 274
Depósitos com pré-aviso e a prazo						
DP DP BIG 07/05 182D 0.0100% 2020-05-07 a 2020-11-05			EUR		24	1 000 274
						20 601 520
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
VALORES ACTIVOS						104 873
VALORES PASSIVOS						-99 439
						5 434
						208 129 624
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
OEUO EUR EUX 09/20	-89	135.18	EUR	135.18		-12 031 020
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					35 412 429.70	
Valor da Unidade de Participação:						€ 5.8773