

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-08-31

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.					6 952	1 634 646
Obrigações diversas						
TAGST 09-ENGY A1/25	503 251	101.43%	EUR	101.43%	400	510 857
CXGD 1% 01/2022	1 100 000	101.57%	EUR	101.57%	6 552	1 123 789
						1 634 646
MERC COT. OFIC. B.V. ESTADOS MEMBROS UE					407 061	146 274 116
Títulos de Dívida Pública						
CCTS Float 06/2022	5 000 000	100.35%	EUR	100.35%	3 976	5 021 476
Obrigações diversas						
NOSPL 1.125% 05/23	2 500 000	101.22%	EUR	101.22%	9 401	2 539 951
SAPGR Float 03/21	2 100 000	100.00%	EUR	100.00%		2 100 084
VW 1.375% 10/2023	500 000	102.14%	EUR	102.14%	6 030	516 705
SAPGR 0.25% 03/2022	500 000	100.54%	EUR	100.54%	599	503 304
VW 1.25% 08/2022	900 000	101.70%	EUR	101.70%	955	916 291
VW Float 02/2021	300 000	100.19%	EUR	100.19%	40	300 598
DB Float 12/2020	2 000 000	99.98%	EUR	99.98%	699	2 000 299
VW 0.5% 06/2022	350 000	100.13%	EUR	100.13%	350	350 816
MRKGR 0.005% 12/2023	400 000	99.93%	EUR	99.93%	14	399 726
EOANGR 0% 09/2022	1 500 000	100.15%	EUR	100.15%		1 502 220
EOANGR 0% 12/2023	650 000	99.97%	EUR	99.97%		649 773
PBBGR Float 07/28/23	2 300 000	99.55%	EUR	99.55%	1 011	2 290 661
PBBGR 0.625% 02/2022	700 000	99.47%	EUR	99.47%	2 283	698 587
BASGR 0.101% 06/2023	400 000	100.30%	EUR	100.30%	97	401 305
IFXGR 0.75% 06/2023	500 000	101.94%	EUR	101.94%	709	510 429
MCFP 1% 09/2021	1 400 000	100.97%	EUR	100.97%	13 120	1 426 756
BNP Float 09/22	1 500 000	101.01%	EUR	101.01%	1 364	1 516 529
BPCEGP Float 03/22	500 000	101.10%	EUR	101.10%	813	506 323
RENAULT Float 04/21	100 000	99.66%	EUR	99.66%	29	99 687
ACAFP Float 04/22	1 000 000	100.78%	EUR	100.78%	419	1 008 219
RENAUL Float 03/2022	400 000	98.73%	EUR	98.73%	270	395 206
GFCFP Float 06/22	1 000 000	99.80%	EUR	99.80%		998 010
RENAULT 0.75% 09/22	2 500 000	98.98%	EUR	98.98%	17 469	2 491 894
ALDFP Float 11/20	500 000	99.94%	EUR	99.94%		499 715
ACAFP Float 03/23	500 000	100.21%	EUR	100.21%	293	501 323
CAFP Float 06/22	2 000 000	100.15%	EUR	100.15%	1 135	2 004 115
HSBC 0.2% 09/21	2 000 000	100.42%	EUR	100.42%	3 967	2 012 287
ACAFP Float 01/2022	1 200 000	100.54%	EUR	100.54%	164	1 206 656
BFCM 0.125% 08/2021	1 500 000	100.42%	EUR	100.42%	10	1 506 310
MCFP 0% 02/2021	300 000	100.10%	EUR	100.10%		300 297
SOCGEN 0% 05/2022	500 000	100.04%	EUR	100.04%		500 175
VIVFP 0% 06/2022	1 400 000	100.00%	EUR	100.00%		1 400 042
BPCEGP Float 01/2023	500 000	99.78%	EUR	99.78%	43	498 958
CAFP Float 09/2023	400 000	99.82%	EUR	99.82%	257	399 541
DSYFP 0% 09/2022	700 000	100.02%	EUR	100.02%		700 133
RENAUL 0.25% 03/23	200 000	97.35%	EUR	97.35%	242	194 940
EFFP 0% 05/23	700 000	99.98%	EUR	99.98%		699 846
CAPFP 0.625% 06/2025	2 000 000	101.70%	EUR	101.70%	2 397	2 036 377
F 1.875% 06/2021	1 000 000	99.11%	EUR	99.11%	3 545	994 685

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
AMSSM 0.125% 10/20	1 000 000	99.94%	EUR	99.94%	1 130	1 000 550
HSBC Float 09/22	750 000	100.27%	EUR	100.27%	410	752 450
CCE FLOAT 11/21	500 000	100.06%	EUR	100.06%		500 320
RBS Float 09/21	1 400 000	100.69%	EUR	100.69%	1 239	1 410 955
DGELN 0.25% 10/2021	1 550 000	100.50%	EUR	100.50%	3 335	1 561 023
RBS Float 06/2021	350 000	100.41%	EUR	100.41%	254	351 696
AALLN 2.875% 11/2020	175 000	100.51%	EUR	100.51%	3 932	179 831
GSK Float 09/2021	500 000	100.37%	EUR	100.37%	188	502 028
RBS Float 03/21	400 000	100.21%	EUR	100.21%	317	401 149
LLOYDS 0.375% 01/25	350 000	99.98%	EUR	99.98%	778	350 691
GSK 0.125% 05/2023	200 000	100.61%	EUR	100.61%	77	201 297
MRLSM 2.225% 04/23	2 000 000	102.55%	EUR	102.55%	15 727	2 066 807
SANSCF1% 05/21	1 400 000	100.82%	EUR	100.82%	3 759	1 415 211
SANTAN Float 03/22	800 000	100.38%	EUR	100.38%	996	804 068
CRUNAV Float 06/2022	500 000	99.33%	EUR	99.33%	257	496 892
CABKSM 1.125% 1/2023	2 700 000	101.35%	EUR	101.35%	19 337	2 755 868
AMSSM Float 03/22	600 000	98.54%	EUR	98.54%	98	591 350
KUTXAB 0.5% 09/2024	200 000	97.62%	EUR	97.62%	934	196 172
SABSM 1.75% 06/2023	200 000	101.77%	EUR	101.77%	614	204 156
SWEDA 0.25% 11/22	3 000 000	100.57%	EUR	100.57%	6 127	3 023 287
VLVY 0.1% 05/2022	300 000	99.78%	EUR	99.78%	82	299 419
SWEDA 0.25% 10/2024	300 000	99.93%	EUR	99.93%	672	300 471
VLVY 0% 02/2023	400 000	99.35%	EUR	99.35%		397 388
ISPIM 2% 06/2021	1 000 000	101.53%	EUR	101.53%	4 110	1 019 410
ISPIM Float 04/22	2 350 000	100.18%	EUR	100.18%	1 406	2 355 636
FCABNK Float 06/21	2 500 000	99.26%	EUR	99.26%		2 481 525
ACEIM Float 06223	200 000	98.83%	EUR	98.83%		197 668
FCABNK 0.625% 11/22	150 000	100.11%	EUR	100.11%	722	150 886
AZMIM 1.625% 12/2024	1 000 000	97.65%	EUR	97.65%	11 721	988 231
FCABNK 0.25% 02/2023	400 000	98.86%	EUR	98.86%	592	396 040
PG 2% 11/21	1 000 000	102.70%	EUR	102.70%	16 448	1 043 468
C Float 05/21	3 000 000	100.51%	EUR	100.51%	226	3 015 586
MS Float 01/22	2 500 000	100.11%	EUR	100.11%	618	2 503 393
WFC Float 01/22	1 000 000	100.25%	EUR	100.25%	37	1 002 567
BAC Float 02/22	1 200 000	100.12%	EUR	100.12%	278	1 201 682
GS Float 09/22	1 500 000	100.09%	EUR	100.09%	970	1 502 260
BAC Float 05/23	1 000 000	100.36%	EUR	100.36%	247	1 003 807
GM Float 05/21	1 800 000	99.57%	EUR	99.57%	227	1 792 424
GE 0.375% 05/22	3 500 000	100.12%	EUR	100.12%	3 848	3 507 943
BAC Float 09/21	2 500 000	100.00%	EUR	100.00%		2 500 050
C Float 03/23	1 000 000	100.01%	EUR	100.01%	219	1 000 339
MS Float 05/21	500 000	100.24%	EUR	100.24%		501 195
T Float 09/23	500 000	100.23%	EUR	100.23%	643	501 788
EMR 0.375% 05/2024	400 000	101.13%	EUR	101.13%	419	404 927
HOG 0.9% 11/19/24	250 000	97.66%	EUR	97.66%	1 764	245 902
FIS 0.125% 12/2022	700 000	100.25%	EUR	100.25%	653	702 396
FIS Float 05/2021	1 500 000	99.87%	EUR	99.87%		1 498 035
CB 0.3% 12/2024	800 000	100.08%	EUR	100.08%	1 770	802 434
GS Float 04/2023	1 000 000	99.80%	EUR	99.80%	125	998 085
F 1.744% 07/2024	800 000	95.62%	EUR	95.62%	1 682	766 658
HON 0% 03/2024	300 000	99.75%	EUR	99.75%		299 247
BRK 0% 03/2025	500 000	99.68%	EUR	99.68%		498 390

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
UBS Float 04/2021	900 000	100.24%	EUR	100.24%	48	902 226
SCANIA Float 03/21	1 100 000	99.85%	EUR	99.85%	221	1 098 538
RENEPL 4.75% 10/2020	1 600 000	100.46%	EUR	100.46%	66 656	1 674 064
ACHMEA 2.5% 11/2020	2 800 000	100.53%	EUR	100.53%	54 891	2 869 619
MYL 1.25% 11/20	400 000	100.10%	EUR	100.10%	3 866	404 274
EDPPL 2.375% 03/23	2 000 000	106.00%	EUR	106.00%	21 082	2 141 162
LPTY Float 11/20	800 000	99.99%	EUR	99.99%	35	799 923
DAIGR Float 05/22	1 500 000	99.85%	EUR	99.85%		1 497 690
NIBCAP 1.5% 01/22	1 000 000	101.24%	EUR	101.24%	8 770	1 021 210
LPTY Float 01/21	200 000	99.87%	EUR	99.87%	9	199 755
ADNA Float 03/21	200 000	99.97%	EUR	99.97%		199 932
BAYNGR Float 06/22	300 000	100.11%	EUR	100.11%	85	300 427
TOYOTA 0.25% 01/2022	2 100 000	100.44%	EUR	100.44%	3 371	2 112 695
BMW 0.625% 10/2023	1 000 000	101.79%	EUR	101.79%	5 652	1 023 572
ANNGR Float 12/2022	2 000 000	99.67%	EUR	99.67%	241	1 993 641
NIBCAP 0.875% 07/25	400 000	98.94%	EUR	98.94%	527	396 267
ENELIM 0% 06/2024	700 000	99.53%	EUR	99.53%		696 738
ALVGR 0% 01/2025	1 300 000	100.51%	EUR	100.51%		1 306 578
DLR 0.125% 10/2022	300 000	100.05%	EUR	100.05%	234	300 384
DANBNK 0.5% 05/21	1 000 000	100.48%	EUR	100.48%	1 616	1 006 436
NYKRE Float 06/22	2 000 000	99.91%	EUR	99.91%	1 330	1 999 510
DANBNK 1,375% 05/23	2 000 000	101.11%	EUR	101.11%	5 681	2 027 881
MINGNO 0.75% 03/23	1 500 000	101.45%	EUR	101.45%	1 849	1 523 644
SPOLNO Float 09/21	1 900 000	100.27%	EUR	100.27%	399	1 905 586
SCBNOR 0.875% 01/22	200 000	100.91%	EUR	100.91%	1 071	202 895
CBSBKF Float 03/21	600 000	99.96%	EUR	99.96%	210	599 976
KBCBB 0.75% 10/23	1 500 000	102.24%	EUR	102.24%	9 805	1 543 420
KBCBB Float 11/22	500 000	100.22%	EUR	100.22%	7	501 117
KBCBB 1.125% 01/2024	400 000	103.51%	EUR	103.51%	2 705	416 757
RBIAS 0.25% 01/2025	1 300 000	99.66%	EUR	99.66%	1 980	1 297 599
DLTAS 2008-1 A	568 462	99.64%	EUR	99.64%	3	566 419
GLENLN 1.625% 01/22	1 500 000	101.22%	EUR	101.22%	15 118	1 533 478
GLENLN 1.25% 03/2021	500 000	100.27%	EUR	100.27%	2 877	504 237
DHR Float 06/22	1 000 000	99.71%	EUR	99.71%		997 110
DE Float 09/20	1 000 000	100.01%	EUR	100.01%		1 000 070
BDX 0.174% 06/2021	1 000 000	99.91%	EUR	99.91%	424	999 504
SUMIBK Float 06/22	1 500 000	100.04%	EUR	100.04%	299	1 500 824
MUFG 0.98% 10/2023	1 000 000	102.64%	EUR	102.64%	8 783	1 035 133
MUFG 0.339% 07/2024	200 000	100.37%	EUR	100.37%	82	200 830
BNS FLOAT 10/22	1 000 000	100.58%	EUR	100.58%	271	1 006 061
BCHINA Float 11/20	300 000	99.97%	EUR	99.97%		299 910
ISLBAN 1.125% 04/22	600 000	100.93%	EUR	100.93%	2 626	608 206
ETISLT 1.75% 06/2021	900 000	101.42%	EUR	101.42%	3 236	915 971
BACR Float 03/2021	900 000	99.39%	EUR	99.39%	144	894 681
WFC Float 04/21	1 000 000	100.27%	EUR	100.27%	167	1 002 867
						141 252 640
MERC.COT.OFIC. DE B.V. DE ESTADOS NÃO EU					52 440	14 072 644
Obrigações diversas						
HUWY 1.375% 10/2021	2 000 000	101.31%	EUR	101.31%	22 992	2 049 252
K 1.75% 05/2021	1 000 000	101.35%	EUR	101.35%	4 795	1 018 245
AMGN 1.25% 02/22	900 000	101.61%	EUR	101.61%	5 809	920 299
F Float 12/21	819 000	95.86%	EUR	95.86%	167	785 269

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
F Float 05/21	300 000	97.66%	EUR	97.66%		292 989
FDX 0.7% 05/2022	500 000	100.99%	EUR	100.99%	1 064	506 019
KO Float 03/2021	400 000	100.14%	EUR	100.14%		400 548
UBS Float 09/22	1 000 000	100.32%	EUR	100.32%	613	1 003 803
ABT 0% 09/2020	1 500 000	100.01%	EUR	100.01%		1 500 150
MDT Cupão Zero 03/21	1 400 000	100.07%	EUR	100.07%		1 400 924
MDT Float 03/2021	2 150 000	100.04%	EUR	100.04%		2 150 882
TACHEM Float 11/22	500 000	101.21%	EUR	101.21%	94	506 164
WESAU 1.25% 10/2021	1 500 000	101.41%	EUR	101.41%	16 906	1 538 101
						14 072 644
						161 981 406
OUTROS VALORES						
VAL. MOBILIÁRIOS NACIONAIS NÃO COTADOS					82	64 550
Obrigações diversas						
VERSE 4 SNR 02/2021	64 249	100.34%	EUR	100.34%	82	64 550
OUTROS INSTRUMENTOS DE DÍVIDA					22 655	8 709 663
Papel Comercial						
PC P.C.EDA 41ª EM. 0.2400% 2020-08-17 a 2020-09-16			EUR		65	650 065
PC ECP JMS 13/03 215D 0.9500% 2020-03-13 a 2020-10-14			EUR		2 671	599 332
PC ECP 23DEZEMBRO-SABA 0.3300% 2019-12-23 a 2020-09-08			EUR		3 008	1 299 917
PC ECP JMS 16/07 123D 1.1000% 2020-07-16 a 2020-11-16			EUR		564	399 087
PC P.C.GLINTT 16ª EM. 3.0000% 2020-08-14 a 2020-10-13			EUR		1 575	1 051 575
PC ECP CIE 16JULHO 62D 0.3500% 2020-07-16 a 2020-09-16			EUR		548	1 199 825
PC ECP JMS 16/07 60D 0.8000% 2020-07-16 a 2020-09-14			EUR		514	499 858
PC P.C.VISABEIRA 30ªEM 3.0000% 2020-06-30 a 2020-09-30			EUR		5 513	1 055 513
PC P.C.GLINTT 14ª EM. 3.0000% 2020-07-10 a 2020-10-08			EUR		3 092	703 092
PC ECP JMS 15/01 273D 1.2500% 2020-01-15 a 2020-10-14			EUR		3 122	399 416
PC P.C.VISABEIRA 32ªEM 3.0000% 2020-08-04 a 2020-10-19			EUR		1 983	851 983
						8 709 663
						8 774 212
UPS DE ORGANISMOS INVEST.COLECTIVO (OIC)						
OIC DOMICILIADOS EM PORTUGAL						9 312 751
Fundimo	1 189 915	7.83	EUR	7.83		9 312 751
LIQUIDEZ						
À VISTA						26 406 503
Depósitos à ordem						
DO CGD - EUR 0.0000%			EUR			14 354 362
DO SANTANDER EU 0.0000%			EUR			256 261
DO SANTANDER - 0.0000%			EUR			11 764 963
DO BCP - EUR 0.0000%			EUR			30 917
						26 406 503
A PRAZO					33	1 000 283
Depósitos com pré-aviso e a prazo						
DP DP BIG 07/05 182D 0.0100% 2020-05-07 a 2020-11-05			EUR		33	1 000 283
						27 406 785

CGD PENSÕES - SGFP,SA

AV. JOÃO XXI, 63 3ºPISO, 1000-300, LISBOA
Fundo de Pensões Aberto: CAIXA REFORMA PRUDENTE
Composição da Carteira em 2020-08-31

Designação	Quantidade	Preço Unit.	Mda	Preço Unit. (EUR)	Juro Corrido (EUR)	Valor Total (EUR)
OUTROS VALORES A REGULARIZAR						
VALORES ACTIVOS						108 033
VALORES PASSIVOS						-121 989
						-13 956
						207 461 199
VALOR LÍQUIDO GLOBAL DO FUNDO						
RESPONSABILIDADES EXTRAPATRIMONIAIS						
OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO						
Em mercado regulamentado						
Futuros						
OEU0 EUR EUX 09/20	-89	134.61	EUR	134.61		-11 980 290
NÚMERO DE UNIDADES DE PARTICIPAÇÃO EM CIRCULAÇÃO					35 243 907.94	
Valor da Unidade de Participação:		€ 5.8864				